

合同编号：宏源期货-2020-D-07

宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划 资产管理合同

投资者：金科地产集团股份有限公司（代金科地产集团股份有限公司卓越共赢计划暨 2019-2023 年员工持股计划之二期持股计划）

管理人：宏源期货有限公司

托管人：申万宏源证券有限公司

目 录

期货公司资产管理业务风险揭示书.....	1
资产合法性及投资者适当性承诺书.....	9
第一章 前言.....	11
第二章 释义.....	12
第三章 声明与承诺.....	15
第四章 当事人及权利义务.....	17
第五章 资产管理计划的基本情况.....	24
第六章 资产管理计划的成立与备案.....	25
第七章 资产管理计划的财产.....	26
第八章 资产管理计划的投资.....	32
第九章 利益冲突及关联交易.....	38
第十章 投资经理的指定与变更.....	39
第十一章 投资指令的发送、确认和执行.....	39
第十二章 交易及清算交收安排.....	45
第十三章 越权交易.....	50
第十四章 资产管理计划资产的估值与会计核算.....	52
第十五章 资产管理业务的费用与税收.....	56
第十六章 资产管理计划的收益分配.....	60
第十七章 信息披露与报告.....	61
第十八章 风险揭示.....	63
第十九章 资产管理合同的变更、终止.....	68
第二十章 资产管理计划资产的清算.....	71
第二十一章 资产管理计划有关文件档案的保存.....	73
第二十二章 违约责任.....	73
第二十三章 法律适用与争议处理.....	74
第二十四章 资产管理合同的效力.....	75
第二十五章 保密.....	75

第二十六章	通知和送达.....	76
第二十七章	其他事项.....	76
附件一	79
附件二	80

期货公司资产管理业务风险揭示书

尊敬的委托人：

投资有风险。当您/贵机构认购或申购资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。资产管理人提醒投资者资产管理计划投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，资产管理计划的相关风险，由投资者自行承担。

根据有关法律法规，资产管理人宏源期货有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、资产管理人声明与承诺

（一）资产管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可，不作为对资产管理计划财产安全的保证。

（二）资产管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

（三）资产管理业务实行“卖者尽责、买者自负”原则，资产管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

二、风险揭示

（一）特殊风险揭示

1、资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理合同是基于中国基金业协会发布的《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，资产管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致的风险。投资者应当认真阅读本合同，理解本合同的全部条款，独立做出是否签署本合同的决定。

2、资产管理计划外包事项所涉风险；

（1）运营服务事项所涉风险

如运营服务机构未按照法律法规规定或运营服务协议约定履行职责，可能导致本计划财产遭

受损失。

(2) 由同一机构提供运营服务和托管服务的风险

本资管计划由申万宏源证券有限公司担任托管人,同时管理人聘请申万宏源证券有限公司为其就本资管计划提供份额注册登记、估值核算相关运营服务。申万宏源证券有限公司已将托管职能和基金服务职能进行分离,恰当的识别、管理、监控潜在的利益冲突。但在同时提供上述服务的情况下,仍可能存在一定的利益冲突风险。

3、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划可能面临管理人未能完成在基金业协会备案手续或迟延完成备案手续,从而导致本计划无法投资或迟延投资,给投资者造成损失的风险。届时,本计划将按照本合同约定进行清算。本计划清算时将扣除产生的相关费用后,向投资者分配本计划剩余财产,投资者最终收到的金额可能小于投资的本金。

4、不设置预警/止损操作可能引起的特定风险

本计划不设置预警、止损操作,计划资产可能发生大幅亏损,甚至本金全部损失。

5、资产管理计划份额转让所涉风险(如有)

份额转让实行非担保交收,转让合同履行风险由转让方、受让方自行控制,因此资产管理计划份额转让可能对转让方或受让方带来风险。

(二) 一般风险揭示

1、本金损失风险

资产管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产,但不保证资产管理计划财产中的认(申)购资金本金不受损失,也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于R4风险投资品种,适合风险识别、评估、承受能力C4、C5的合格投资者及专业投资者。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动,导致收益水平变化产生的风险。主要包括:政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险、上市公司经营风险等。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中,资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险,由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关

风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

6、募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

资产管理人的责任承担方式：

- (1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- (2) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已缴纳的款项，并加计人民银行同期活期存款利息。

7、投资标的的风险

(1) 本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

(2) 本计划投资人需要遵守法律法规、监管机构及员工持股计划关于信息敏感期不得买卖股票、法定锁定期及归属锁定期（如适用）等限制性规定，遵守以上限制性规定有可能导致本计划无法在预期时间内变现，从而为投资人带来流动性风险

(3) 融资融券风险

本计划可以参与融资融券交易，可能面临包括但不限于以下风险：

① 因资产管理人或本计划自身变化原因导致损失的风险，原因包括但不限于：资产管理人在从事融资融券交易期间，因法律法规规定或监管原因导致资产管理人或本计划被暂停或取消融资或融券资格；资产管理人信用资质状况发生变化导致证券公司降低其授信额度，并由此导致资产管理人不能从事融资融券交易或该资产管理人适用的相关风险控制指标被证券公司单方面提高；因本计划自身原因导致其资产被司法机关或其它有权机关采取财产保

全或强制执行措施，或者出现终止、清算情况时，本计划将面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险；因本计划不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险；本计划融资融券交易被证券公司强制平仓或终止时，若参与融资融券交易的担保物不足以清偿证券公司债务的，本计划其他财产面临被证券公司追偿的风险。

②政策风险，包括但不限于：因交易所、监管机关要求或证券公司自身管理需要发生融资融券标的证券范围调整、可充抵保证金证券范围或折算率调整、标的证券暂停交易或终止上市、保证金比例调整、预警线、平仓线指标调整等情况，本计划将可能面临被证券公司限制交易或提前了结融资融券交易的风险；由于国家法律、法规、政策的变化，证券交易所交易规则的修改等原因，可能会对参与融资融券业务的本计划造成经济损失。

③市场风险：在融资融券合同有效期内，证券公司可能调高融资利率或融券费率，本计划将面临融资融券成本增加的风险。

④杠杆风险：融资融券交易与普通证券交易不同，具有财务杠杆放大效应，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

⑤委托人已知悉并同意，若本单一计划参与融资融券业务，只进行融资交易不进行融券交易，并且相关融资款项仅用于购买【金科地产集团股份有限公司（股票代码：000656）】的股票，不得用作其他用途。

⑥委托人已知悉并自愿承担本计划参与融资融券交易的投资风险。当本计划参与的融资融券交易维持担保比例低于《融资融券业务合同》及相关申请文件等约定的平仓线或最低线时，管理人收到融资融券服务提供券商补交担保物通知的当日通过邮件、电话、传真或书面方式中的一种或多种方式通知委托人，委托人需在通知要求的时间内足额追加风险调整资金至托管户，使维持担保比例符合《融资融券业务合同》及相关申请文件等相关约定；如委托人未在通知要求时间内足额追加风险调整资金导致违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。通知的发送以管理人的发送记录为准。

特别提示：若本单一计划参与融资融券交易，委托人知悉并同意相关约定以融资融券服务提供券商与本单一计划签订的《融资融券业务合同》及相关申请文件等为准。如因委托人原因导致本计划在履行《融资融券业务合同》及相关申请文件等过程中违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。

8、 税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化,投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

9、关联交易风险(如有)

本计划可投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或进行其他关联交易,这将构成本计划与相关方的关联交易,可能存在关联交易风险。

10、法律和政策风险

本计划在设计或运作过程中,需要遵守国家法律法规及政策的规定。国家和地方法律、法规的变化以及相关货币政策、财政政策、产业政策、区域政策及政府对市场监管政策的调整可能会导致本计划需要进行相应的调整、遭受损失甚至终止的风险。

11、不可抗力风险

战争、自然灾害、政府行为等不可抗力可能导致资产管理计划财产有遭受损失的风险,以及资产管理人、资产托管人可能因不可抗力无法正常工作,从而有影响本计划份额申购、赎回的风险。金融市场危机、行业竞争等超出管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致份额持有人利益受损。

在资产管理合同终止时,因投资组合内股票停牌等不可抗力的因素,本资产管理计划可采取现金部分先行给付等相关处理方式。现金部分按资产委托人持有的计划份额比例,扣除相关费用后分配给资产委托人,非现金部分将在变现并扣除相关费用后,分配给资产委托人。

12、操作或技术风险:

相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在本计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响,例如IT系统故障等风险。这种技术风险可能来自资产管理人、资产托管人、证券/期货经纪机构、份额登记机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

在实际操作中,由于资产管理人的审批流程、决策机制、后台操作等存在时滞,可能导致投资产生一定的损失。

13、估值风险

本计划采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示本计划所持资产的实际价值,或经济环境发生重大变化时,在一定时期内可能高估或低估本计划资产净值。管理人将在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上,与托管人协商,调整相应投资品种的估值,使调整后的本计划资产净值更公允地反映计划资产价值。

14、提取份额受限的风险

本计划非开放日不接受委托人的提取申请。委托人将面临在投资期内无法按意愿提取份额的风险。

15、本计划存在提前终止的风险

如发生本合同约定的情形,本计划存续期限将相应提前终止,委托人将面临无法按预期获得收益或无法按意愿退出投资的风险。

16、关于风险收益特征的风险揭示

资产管理人将本计划评级为 R4 投资品种。管理人对本计划的风险评级及对投资者的风险评级的方法和方式可能影响测评结果的客观性和准确性。管理人提出的适当性匹配意见不表明本计划的风险和收益做出实质性判断或者保证,其履行投资者适当性职责不能取代委托人的投资判断,不会降低本计划的固有风险,也不会影响委托人依法应当承担的投资风险、履约责任以及费用。(若代销机构根据其风险等级划分方法对本计划风险收益特征的评定与本合同约定不一致,投资者通过代销机构申/认购本计划份额的,产品风险等级及投资者适当性匹配意见以代销机构为准)。

托管人及运营服务机构不参与本计划的风险评级和投资者的适当性评估程序。

17、托管风险

如托管人未按照法律法规规定或资产管理合同约定履行托管职责,可能导致本计划财产遭受损失。

托管人仅按照本合同约定的标准及范围履行投资监督职责,并不能确保管理人完全按照相关法律法规及本合同约定进行投资运作。

18、管理人/托管人不能继续履行职责的风险

如在本计划存续期间管理人/托管人因停业、解散、撤销、破产,或者被监管部门撤销相关业务许可而不能继续履行资管合同项下的职责,可能会对本计划产生不利影响。

19、资产管理合同变更风险

管理人有可能按照本合同约定的程序和方式变更本合同条款,该等变更不一定与委托人意愿一致,委托人可能面临本合同条款变更的风险。

三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构做出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【_____】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【_____】

2、本人/机构知晓，资产管理人、销售机构、资产托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【_____】

3、本人/机构已符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【_____】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十一章“资产管理计划的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十二章“资产管理业务的费用与税收”中的所有内容。【_____】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十九章“法律适用与争议处理”中的所有内容。【_____】

9、本人/机构已经配合资产管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。【_____】

10、本人/机构知晓，证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【_____】

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。【_____】

12、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【_____】

13、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【_____】

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

资产管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）：

日期：

资产合法性及投资者适当性承诺书

本人/本单位以真实身份参与资产管理计划参与资产管理计划。本人/本单位承诺计划资金来源及用途合法，不属于违反规定的公众集资，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，符合有关反洗钱法律法规的要求。宏源期货有限公司有权要求本人/本单位提供资金来源及用途合法性证明，对资金来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。

本人/本单位符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，满足以下要求：

1、符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条规定的“合格投资者”是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

(1) 具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元。

(2) 最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位。

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品。

(5) 基本养老保险、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）。

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

合格投资者投资于单只固定收益类资产管理计划的金额不低于30万元，投资于单只混合类资产管理计划的金额不低于40万元，投资于单只权益类、商品及金融衍生品类资产管理计划的金额不低于100万元。资产管理计划投资于《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十七条第（五）项规定的非标准化资产的，接受单个合格投资者委托资金的金额不低于100万元。

2、本人/本单位承诺不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。如法律法规对合格投资者有新的规定的，本产品依据最新规定执行。

3、本人/本单位未被法律、法规、监管机构或公司内部决策程序限制参与期货资产管理业务。

本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则本人承担由此产生的相关责任，且【宏源期货有限公司】有权解除资产管理合同，本人违反委托资金来源及用途合法性承诺的，【宏源期货有限公司】还有权依法限制本人/本单位提取该委托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。

承诺人：

(签字或盖章)

日期： 年 月 日

第一章前言

(一) 为规范宏源期货有限公司(以下简称“管理人”)资产管理业务的运作,明确当事人的权利与义务,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国证券法》、《期货交易管理条例》、《中华人民共和国合同法》、《期货公司监督管理办法》、《期货公司资产管理业务管理规则(试行)》(以下简称《管理规则》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)、《中国人民银行、银监会、证监会、保监会、外汇局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》等法律、行政法规和中国证监会、中国期货业协会(以下简称“期货业协会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)的有关规定,为了充分保护本合同各方当事人的合法权益,委托人、管理人和托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。

(二) 委托人保证委托资产的来源及用途合法,保证未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划,且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。签订本合同之前已阅知本合同全文和《期货公司资产管理业务风险揭示书》,签订了《资产合法性与投资者适当性承诺书》,并已经了解所有相关权利、义务和风险,明确知悉应自行承担投资风险。

(三) 管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用计划资产,但不保证计划资产一定盈利,亦不承担计划资产的最低收益或者分担损失。管理人过往业绩和对计划资产未来的收益预测仅供委托人参考,不构成管理人保证计划资产不受损失或取得最低收益的承诺。

(四) 托管人作为计划资产的托管机构承诺按照诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管委托人的计划资产,并履行本合同约定的相关义务。

(五) 管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案,并抄报中国证监会相关派出机构。

(六) 证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能

出现的损失。

第二章释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

- 1、资产管理计划、本计划、计划：指宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划。
- 2、本合同、资产管理合同：委托人、管理人和托管人签署的《宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更。
- 3、资产委托人、委托人、投资者、投资人、客户：指【金科地产集团股份有限公司（代金科地产集团股份有限公司卓越共赢计划暨 2019-2023 年员工持股计划之二期持股计划）】。
- 4、资产管理人、管理人：指【宏源期货有限公司】。
- 5、资产托管人、托管人：指【申万宏源证券有限公司】。
- 6、合同当事人：指资产委托人、资产管理人和资产托管人。
- 7、资产管理计划运营服务机构：接受资产管理人委托，根据与其签订的资产管理计划运营服务合同中约定的服务范围，为本计划提供份额登记、估值核算等服务的机构。本计划的运营服务机构为【申万宏源证券有限公司】。运营服务机构已完成在中国基金业协会的备案，编号为 A00038。
- 8、资产管理计划运营服务：指资产管理计划运营服务机构根据资产管理人的委托，为本计划提供的份额登记、估值核算等基金运营相关的服务。
- 9、份额登记机构：指办理资产管理计划份额登记业务的机构。份额登记机构为资产管理人或接受资产管理人委托代为办理份额登记业务的机构。本计划的份额登记机构为【申万宏源证券有限公司】。
- 10、证券经纪机构：指资产管理人指定且经资产托管人同意的为本计划提供证券经纪服务的机构。
- 11、期货经纪机构：指资产管理人指定且经资产托管人同意的为本计划提供期货经纪服务的机构。
- 12、证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所、香港联合交易所，简称“交易所”。
- 13、期货交易所：指上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、上海国际能源交易中心和中国金融期货交易所。

14、计划资产、委托资产：指委托人拥有所有权或合法处分权，委托管理人管理的作为本合同标的的财产。

15、资产管理计划资产总值：指资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收认购款及其他资产的价值总和。

16、资产管理计划资产净值：指资产管理计划资产总值减去资产管理计划负债后的价值。

17、资产管理计划资产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定资产管理计划资产净值和资产管理计划份额净值的过程。

18、资产管理计划份额净值：指估值日资产管理计划资产净值除以估值日资产管理计划份额总数。本计划份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

19、资产管理计划份额累计净值：指资产管理计划份额净值和资产管理人计划历史上累计份额派息金额之和。

20、工作日、交易日：均指证券交易所、期货交易所的正常交易日。

21、T 日：与本计划有关的事项发生的日期。

22、T+n 日：T 日后的第 n 个工作日（n 为整数），当 n 为负数时表示 T 日前的第 n 个工作日。

23、年、年度、会计年度：指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

24、计划运作年度：指本计划成立日或成立日的对日起算，实际存续天数满一个自然年度的期间。例：计划成立日为 2019 年 5 月 30 日，则满一年的日期为 2020 年 5 月 29 日。

25、托管资金专用账户、托管资金账户、托管账户：指资产托管人根据有关规定为本资产管理计划在具有基金托管资格的商业银行开立的专门用于清算交收的银行账户。

26、募集账户：即本计划的注册登记账户，是由资产管理人或其委托的运营服务机构在商业银行开立的资产管理计划募集结算专用账户，用于统一归集资产管理计划募集结算资金、向投资者分配收益、给付提取款项以及分配资产管理计划清算后的剩余财产等。

27、委托人账户：指以委托人名义开立的，委托人移交、追加本计划的划出账户与提取本计划的划入账户，划出账户与划入账户应为同一账户。

28、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由资产管理人或资产托管人或资产委托人为资产管理计划财产在中登公司上海分公司、深圳分公司、北京分公司开设的专用证券账户，以及在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户。中登公司另有规定的，可按照规定办理。

29、**证券交易资金账户**：资产管理人或资产托管人或资产委托人为计划财产在证券经纪机构开立的证券交易资金账户，用于资产管理计划财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。证券交易资金账户应按照“第三方存管”模式与托管账户建立一一对应关系，通过银证转账的方式完成资金划付。中登公司另有规定的，可按照规定办理。

30、**期货账户**：资产管理人或资产托管人为计划财产在期货经纪机构开立的期货保证金账户，用于资产管理计划财产期货交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及期货交易清算。期货保证金账户应与托管账户建立一一对应关系，通过银期转账和非银期转账（手工出入金）办理期货交易的出入金。

31、**存续期**：指资产管理合同生效至终止之间的期限。

32、**认购**：指在资产管理计划成立前，资产委托人按照本合同的规定购买本计划份额的行为。

33、**追加**：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定购买计划份额的行为。

34、**提取**：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定将计划份额兑现为现金的行为。

35、**不可抗力事件**：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用或没收、法律法规变化、相关交易所非正常暂停或停止交易以及非当事人所引起或能控制的计算机系统、通讯系统、网络系统、电力系统故障或其他突发事件等情形。

36、**《暂行规定》**：指《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》。

37、**《指导意见》**：指《中国人民银行、银监会、证监会、保监会、外汇局关于规范金融资产管理业务的指导意见》。

38、**法律法规**：指中国公布实施并现时有效的法律、行政法规、部门规章及规范性文件。

39、**行业自律规则**：简称“自律规则”，指行业自律组织发布的自律规则。

40、**证监会**：中国证券监督管理委员会。

41、**金融监管部门**：指负责金融市场监管的机关和行业自律组织。

42、**证券投资基金业协会、基金业协会、中基协**：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织，指中国证券投资基金业协会。

43、**结算价**：是指某一期货合约当日交易期间成交价格按成交量的加权平均价，当日无成交的，以上一交易日的结算价作为当日结算价。

44、**盘中市价**：是指某交易日某一期货合约交易期间的即时成交价格。

45、**收盘价**：是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。

第三章 声明与承诺

（一）委托人的声明与承诺

1、委托人承诺其为符合《运作规定》要求的合格投资者，且不是管理人的董事、监事、从业人员及其配偶，具有合法参与期货公司资产管理业务的资格，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与资产管理业务的情形；向管理人或代销机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人。

2、委托人承诺以真实身份参与资产管理业务，向管理人提供的资产证明、投资经历证明以及资金来源、债务情况说明等相关材料真实、完整、合法、有效。

3、委托人声明已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，委托人接受管理人的审慎评估并经自我评估认为具备参与资产管理业务的风险承受能力，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4、委托人声明已听取了管理人对管理人业务资格的披露和对相关业务规则、合同条款、资产管理方案和交易策略的讲解，已阅读并理解风险揭示书的相关内容，清楚认识委托投资存在的市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险，并承诺自行承担投资风险和损失；

5、委托人保证其投资于计划的委托资产为自有资金，委托资产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，符合有关反洗钱法律法规的要求，且委托资产中没有违反规定的公众集资、非法配资、非法募集资金等；本合同项下委托资产来源于标的公司计提的持股计划专项基金，符合法律法规、监管机构和员工持股计划的相关规定，并可用于投资本合同项下标的股票，不存在任何可能妨碍管理人对委托资产进行管理运作的情形；投资事项符合法律法规的规定、员工持股计划的规定及业务决策程序的要求。委托人同时保证委托资产没有设置任何可能涉及第三方的权利主张，也没

有任何其它限制性条件妨碍管理人对该计划资产行使投资管理权；本合同投资范围及各项投资限制的约定符合对投资者及员工持股计划所适用的法律法规、相关监管机构的规定及其内部管理制度，并已取得所有必要的资格、批准、许可、备案或者登记等，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件，没有任何其他限制性条件妨碍管理人按照本合同约定对委托财产行使投资管理权。

6、本合同由委托人保证其法定代表人、单位负责人或其授权代表有充分和完整的授权签署本合同，并在本合同上加盖委托人公章或者合同专用章。本合同经委托人正式签署后即构成对委托人合法、有效、可执行及有约束力的法律文件。

7、委托人声明，管理人未对计划资产的收益状况做出任何承诺或担保。

8、委托人声明不允许资产管理账户参与商品期货实物交割。

9、员工持股计划及其设立过程合法合规，已充分征求员工意见并已取得参与员工的认可，已按照相关法律法规准确、及时地履行了信息披露义务。

10、委托人已知悉并同意，若本单一计划参与融资融券业务，只进行融资交易不进行融券交易，并且相关融资款项仅用于购买【金科地产集团股份有限公司（股票代码：000656）】的股票，不得用作其他用途。

11、委托人已知悉并自愿承担本计划参与融资融券交易的投资风险。当本计划参与的融资融券交易维持担保比例低于《融资融券业务合同》及相关申请文件等约定的平仓线或最低线时，管理人收到融资融券服务提供券商补交担保物通知的当日通过邮件、电话、传真或书面方式中的一种或多种方式通知委托人，委托人应在通知要求的时间内足额追加风险调整资金至托管户，使维持担保比例符合《融资融券业务合同》及相关申请文件等相关约定；如委托人未在通知要求时间内足额追加风险调整资金导致违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。

特别提示：若本单一计划参与融资融券交易，委托人知悉并同意相关约定以融资融券服务提供券商与本单一计划签订的《融资融券业务合同》及相关申请文件等为准。如因委托人原因导致本计划在履行《融资融券业务合同》及相关申请文件等过程中违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。

（二）管理人的声明与承诺

1、管理人是依法设立的期货经营机构，并具有资产管理业务资格。

2、管理人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会有关规定，诚实守信，审慎尽责，坚持公平交易，保护委托人合法权益。

3、在签订本合同前充分地向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

4、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

5、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

6、管理人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。

7、管理人声明不以任何方式向委托人承诺或担保取得最低收益或分担损失。

8、管理人声明禁止管理员工以个人名义接受委托人资产管理委托或向委托人作出最低收益和分担损失的承诺。请您不要与本公司员工就上述事项达成任何私下协议，如您违反本约定和本公司规定与本公司员工达成私下协议，管理人不承担任何法律责任并保留追究委托人法律责任的权利。

（三）托管人的声明与承诺

1、托管人具有中国证监会认可的从事资产托管业务的资格。

2、托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。资产托管人不为本计划的本金或收益提供担保。资产托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。如该资料、信息是依据从资产管理人或第三方处获得的数据而编制的，则资产托管人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导。

3、托管人承诺遵守法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

4、托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。

5、资产托管人在将其托管职能与服务职能分离，且能恰当识别、管理、监控托管职能与服务职能潜在的利益冲突的条件下，可同时担任本计划服务机构。

6、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定履行受托职责，维护投资者权益。

第四章 当事人及权利义务

（一）资产委托人

1、资产委托人概况

名称：【金科地产集团股份有限公司（代金科地产集团股份有限公司卓越共赢计划暨2019-2023年员工持股计划之二期持股计划）】

住所：【重庆市两江新区春兰三路1号地矿大厦七楼】

通讯地址：【重庆市两江新区春兰三路1号地矿大厦七楼】

法定代表人：【蒋思海】

联系人：【石诚】

联系电话：【023-63023656】

2、资产委托人的权利

- (1) 按照本合同约定取得资产管理计划财产收益。
- (2) 按照本合同约定取得清算后的剩余资产管理计划财产。
- (3) 按照本合同的约定追加或提取计划份额。
- (4) 按照本合同的约定追加或提取风险调整资金。
- (5) 监督资产管理人履行投资管理职责及资产托管人履行托管义务的情况。
- (6) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料。
- (7) 国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

3、资产委托人的义务

- (1) 认真阅读并遵守本合同，保证以真实身份参与资产管理计划。
- (2) 保证委托资金来源合法及用途合法，承诺投资资产管理计划的最终资金来源不存在为贷款、发行债券等筹集的非自有资金的情形。
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源。
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书，自行承担本资产管理计划的投资风险和损失。
- (5) 按照资产管理合同的约定，将委托财产交付资产管理人和资产托管人分别进行投资管理和资产托管，以委托财产为限依法承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。
- (6) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件。
- (7) 及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况。
- (8) 向管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其代销机

构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；在向管理人或其代销机构提供的各种资料、信息、联系方式发生变更时，及时通知管理人；在身份证明证件超过有效期时，应当配合管理人提供新的有效身份证明文件。

(9) 不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为。

(10) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动。

(11) 按照资产管理合同承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费、合同印制费（如有）等合理费用。

(12) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划财产投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动。

(13) 投资者联络方式变更的，应主动联系管理人进行信息更新。

(14) 授权资产管理人代表资产委托人，与资产托管人、期货经纪商和证券经纪商签署期货和证券操作备忘录。

(15) 协助资产管理人办理资产管理业务相关账户设立、变更及注销手续，并不得将相关账户以出租、出借、转让或者其他方式提供给他人使用。

(16) 保证其参与单一资产管理业务并将委托资产用于投资本合同项下标的股票符合法律法规和相关监管机构以及员工持股计划的规定，保证其已获必要和充分的授权与批准将委托资产用于投资标的股票；

(17) 及时、准确向管理人书面告知或应管理人要求书面确认法律法规、监管机构及员工持股计划规定不得买卖股票的时点，以及法定锁定期及归属锁定期（如适用）等限制性规定，不得利用员工持股计划及本合同从事内幕交易、操纵证券市场等证券欺诈行为，委托人/管理委员会不利用所掌握的内幕信息向管理人发出任何追加或提取申请，不以任何方式向管理人提供或泄露任何内幕信息；

(18) 保证委托人或管理委员会向管理人发出的书面通知（包括但不限于书面告知、确认、追加申请、提取申请等）符合中国法律法规、监管机构及员工持股计划的规定，已按照中国及投资所在地法律法规、监管机构及员工持股计划的规定获得合法有效的授权，不存在中国及投资所在地违反法律法规、监管机构及员工持股计划关于信息敏感期、股票交易锁定期不得买卖股票等规定的情形，不存在违反上市公司股东、董监高减持股份的规定的规定的情形，也不存在中国及投资所在地法律法规、监管机构及员工持股计划所禁止的其他情形（包括但不限于为自身或他人谋取不正当利益，从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当证券

投资交易活动等)；委托人违反本条约定的，需承担本计划项下交易违反中国及投资所在地法律法规、相关监管机构规定或命令或员工持股计划相关规定而给管理人造成的相应损失；

(19) 委托人应自行关注和监控本计划所持有的股票是否存在减持限制等处置限制(包括但不限于员工持股计划与员工是否构成一致行动关系等)，履行相应的信息披露义务并及时告知管理人；如因上述限制导致管理人无法及时、足额处置该等股票的，管理人不承担责任；

(20) 员工持股计划管理办法(如有)的制定或修订如涉及管理人或托管人的权利义务以及本合同的履行，应事先征询管理人和托管人的意见，并协商取得一致意见后施行；

(21) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(二) 资产管理人

1、资产管理人概况

名称：宏源期货有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街19号4层4B

通讯地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层邮政编码：100044

法定代表人：王化栋

注册资本：10亿元

联系人：王听雨

联系电话：010-82292116

网站：<http://www.hongyuanqh.com/>

2、资产管理人的权利

(1) 要求委托人提供与其身份、财产与收入状况、资金来源及用途、资产管理需求、风险认知与承受能力等相关的信息和资料，对委托人适当性进行审慎评估。

(2) 按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产，不受资产委托人的直接或间接(包括但不限于发出投资建议或投资指令等方式)影响。

(3) 依照本合同的约定，及时、足额获得资产管理费、业绩报酬(如有)等管理人应收取的费用，按本合同约定以计划财产支付应由计划财产承担的交易费用、税费及其他费用。

(4) 依照有关规定和本合同的约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

(5) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告证监会相关派出机构及证券投资基金业协会。

(6) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查。

(7) 以资产管理人的名义，代表本资产管理计划与其他第三方签署本计划投资相关协议文件、行使诉讼权利、办理相关权利登记变更等手续或者实施其他法律行为。

(8) 根据反洗钱相关法规的规定，委托人应当提供有效的身份证明文件。若委托人身份证明文件超过有效期，在合理的期限范围内未向管理人提供新的有效身份证明文件且未提出合理理由的，则管理人有权单方面终止资产管理合同。

(9) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、资产管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的备案事宜。

(2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。

(3) 制定和执行资产管理投资策略，按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产。

(4) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产。

(5) 建立健全内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制。

(6) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

(7) 对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金，并履行相关法律法规、监管规定要求的投资者适当性管理职责。

(8) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。

(9) 按照本合同的约定接受和配合资产委托人和资产托管人的监督。

(10) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

(11) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告。

(12) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制资产管理计划财务会计报告。

(13) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益。

(14) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报证监会相关派出机构。

(15) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项。

(16) 组织并参加资产管理财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配。

(17) 公平对待所管理的不同资产管理计划财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

(18) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资。

(19) 保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、委托人相关信息等，但法律法规、本合同、监管机构、行业协会、审计机构另有规定的除外。

(20) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于20年。

(21) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者。

(22) 通过合同约定证券/期货经纪服务机构及时向资产托管人、运营服务机构发送结算数据、对账单等估值所需的资料；

(23) 确保本计划宣传资料（如有）真实、准确、完整，不得进行虚假宣传。资产管理人制作的宣传材料涉及资产托管人的，仅可表述为“申万宏源证券为本产品的资产托管人”，不得以资产托管人的名义进行任何其他宣传，资产托管人有权对资产管理人及本计划宣传材料进行检查，资产管理人违反上述约定的，资产托管人有权向资产管理人追责。

(24) 妥善保管投资者签署的资产管理合同原件，如管理人未将托管人应保留的资产管理合同原件寄送托管人，且资产托管人需查询、调取资产管理合同原件的，资产管理人应予以协助，因资产管理人未提供协助导致本合同各方当事人损失及其他不利后果的，资产管理人应承担赔偿责任。

(25) 本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，资产管理人应妥善保管并按合同约定及时向资产托管人移交托管人应保留的投资者签署的资产管理合同原件，因资产管理人未妥善保管或未及时向资产托管人移交资产管理合同原件导致本合同各方当事人损失及其他不利后果的，资产管理人应承担赔偿责任。

(26) 国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他

义务。

(三) 资产托管人

1、资产托管人概况

名称：申万宏源证券有限公司

法定代表人：杨玉成

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

通讯地址：北京市西城区太平桥大街19号

邮编：100033

联系电话：010-88013619

2、资产托管人的权利

(1) 依照本合同的规定，及时、足额获得资产托管费。

(2) 根据本合同的规定，依法保管资产管理计划财产。

(3) 依据法律法规、行业自律规则规定、本合同的约定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反法律法规、行业自律规则规定、本合同约定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国基金业协会并采取必要措施。

(4) 除法律法规另有规定的情况外，因资产管理人过错造成的资产管理计划财产损失由资产管理人承担责任。

(5) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、资产托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产，不得擅自用或处分托管资产。

(2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保客户委托资产与托管机构自有资产及其他客户的委托资产相互独立。

(4) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产。

(5) 按规定开设和注销资产管理计划的托管账户等投资所需账户，管理人自行开立的账户除外。

(6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值，办理与资产管理计划托管业务有关的信

息披露事项。

(7) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核资产管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见。

(8) 编制资产管理计划的年度托管报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。

(9) 按照法律法规要求和本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

(10) 按照约定的方式、时间向资产管理人提供资产管理计划与托管事务相关的委托资产信息。

(12) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划资产管理的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年。

(13) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

(14) 保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但法律法规、本合同及监管机构另有要求的除外。

(15) 按照法律法规及本合同规定监督资产管理人的投资运作，发现投资或清算指令违反法律、行政法规和其他有关规定、中国证监会的规定或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。

(16) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示。

(17) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

第五章资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划

(二) 资产管理计划的类别

【权益类】单一资产管理计划。

(三) 本资产管理计划为员工持股计划。

(四) 运作方式

契约型开放式。本资产管理计划定期开放，开放日为每周三，遇节假日顺延至下一工作日。开放日可办理追加、提取。

具体约定详见本合同第七章“资产管理计划的财产”。

(五) 资产管理计划的投资目标、主要投资范围、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

详见本合同第八章“资产管理计划的投资”。

2、主要投资方向/投资范围

详见本合同第八章“资产管理计划的投资”。

3、投资比例

详见本合同第八章“资产管理计划的投资”。

4、产品风险等级

本资产管理计划的风险收益特征，属于R4风险级别，适合风险识别、评估、承受能力C4、C5的合格投资者及专业投资者。

(六) 存续期限

自计划成立之日起2年，资产委托人、资产管理人、资产托管人在本计划到期前5个工作日内未提出书面异议，则由资产管理人发布延期公告自动展期1年。

(七) 最低初始规模

本资产管理计划的初始规模不低于人民币【1000】万元。

(八) 托管机构

本计划的托管人为【申万宏源证券有限公司】。

(九) 运营服务机构

本计划份额登记、估值与核算由运营服务机构【申万宏源证券有限公司】办理，运营服务机构登记编码为：A00038。

第六章 资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划的成立

1、资产管理计划成立的条件

- (1) 资产委托人、资产管理人与资产托管人均签署本资产管理合同。
- (2) 本计划初始资产达到最低初始规模【1000】万元人民币；
- (3) 本计划初始参与资金已划转至托管账户；

(4) 资产管理人通知资产委托人、资产托管人资产管理计划成立。

2、资产管理计划在受托资产到达托管户后，资产管理人书面通知资产委托人、资产托管人资产管理计划成立。

(二) 资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立起5个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

(三) 资产管理计划不能满足备案条件的处理方式

若本资产管理计划成立后无法完成备案，则管理人经与资产委托人、资产托管人协商一致，有权公告本资产管理计划提前终止。本计划终止后，按照本合同约定的清算程序进行清算。

(四) 资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。备案完成后，应及时告知资产托管人。

第七章 资产管理计划的财产

(一) 资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。资产托管人对实际交付并控制下的资产管理计划财产承担保管职责。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

2、除本条第3款规定的情形外，资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

3、资产管理人、资产托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

4、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托

管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

5、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

6、本资产管理计划项下托管账户内的现金资产由托管人负责保管。对于本资产管理计划项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产（包括现金类资产与非现金类资产），由资产管理计划财产的保管人或实际控制人对其安全性和完整性进行监管并承担责任。由管理人负责保管本资产管理计划对外投资过程中形成的股权、债权、收益权等非现金资产及相关权利凭证，并应及时将相关权利凭证的复印件加盖公章或者其他有效签章后交付托管人。管理人应对本资产管理计划项下非现金资产及其权利凭证的安全和完整负责。除资产管理合同另有约定外，管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

7、本资产管理计划项下，管理人代表本资产管理计划与交易对手签订投资协议、开立相关账户及办理相关登记手续，并按照投资协议的约定行使相关权利和履行相关义务。

8、托管期间，如相关监管机构或法规对资产管理计划财产的保管事宜另有规定的，从其规定。

9、资产托管人对所托管的不同资产管理计划财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整和独立。

10、对于因为资产管理计划财产投资产生的应收资产，应由资产管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知资产托管人，到账日本计划资产没有到达本计划托管账户的，资产管理人应及时采取措施进行催收。由此给本计划造成损失的，资产管理人应负责向有关当事人追偿本计划的损失。

11、资产管理人、资产托管人不得违反法律法规、行业自律规则的规定和本合同约定擅自将资产管理计划财产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

（二）计划财产相关账户的开立和管理

1、托管账户的开设和管理

（1）托管人按照规定在商业银行开立与本计划有关的资金账户，管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。

（2）托管账户的开设和管理由托管人负责。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于对外投资、支付提取金额、支付计划收益、收取追加款，均需通过该账户进行。

（3）托管账户的开立和使用，限于满足开展资产管理业务的需要。托管人和管理人不得

得假借本计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本计划的任何银行账户进行本资产管理业务以外的活动。

(4) 资产托管人可以通过申请开通本计划银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用企业网上银行（简称“网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

(5) 本计划托管账户的管理应符合法律法规、行业自律规则以及银行业监督管理机构的有关规定。

2、证券账户

按照证监会关于上市公司员工持股计划的指导意见，本计划所使用的证券账户为以员工持股计划名义开立的证券账户，由委托人开立或者由管理人代为开立，其他合同当事人应配合提供开户、变更、销户需要的相关资料。管理人需及时向托管人提供本产品对应的证券账户信息，并保证该信息的准确性。证券账户由委托人销户或者由管理人办理代为销户的，管理人需及时向托管人提供成功销户信息。中登公司另有规定的，可按照规定办理。

在合同期限内，该证券账户仅供本单一资产管理计划使用，并且只能由管理人使用，不得转托管或者转指定，中国证监会另有规定的除外。委托人、管理人不得将专用证券账户以出租、出借、转让或者其他方式提供给他人使用。

3、其他账户的开设和管理

因投资运作而需要开立的其他账户，由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立，相关机构另有规定的，可按照相关规定办理。如该等账户是由管理人负责开立的，管理人开立此类账户后需及时通知托管人，且应保证该账户专款专用。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定，证券交易资金账户按照“第三方存管”模式与托管账户建立一一对应关系，期货保证金账户应与托管账户建立一一对应关系。

4、开立的上述计划财产账户与管理人、托管人、募集机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他计划财产账户相独立。

(三) 资产管理计划财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管
资产管理计划财产投资的实物证券由资产托管人存放于资产托管人或其他资产管理人与资产托管人协议一致的第三方机构的保管库。实物证券的购买和转让，由资产托管人根据资产管理人的指令办理。对由资产托管人以外机构实际有效控制的本计划资产，由实际控制机构负责保管。

银行存款定期存单等有价凭证由资产托管人负责保管。

(四) 与资产管理计划财产有关的重大合同的保管

由资产管理人代表本计划签署的与资产管理计划财产有关的重大合同的原件分别由资产托管人、资产管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本合同另有规定外，资产管理人在代表本计划签署与资产管理计划财产有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便资产管理人和资产托管人至少各持有一份正本的原件，资产管理人应及时将正本送达资产托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，资产管理人应向资产托管人提供加盖公章或授权业务章的合同复印件或原件的扫描件，合同原件由资产管理人保管；未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

因资产管理人未按本合同约定及时向资产托管人移交重大合同原件或复印件导致的法律责任，由资产管理人自行承担。

（五）委托财产的移交

1、资产管理计划的初始委托财产为货币资金，初始委托财产价值不得低于最低初始规模。

2、资产委托人应与资产管理人、资产托管人签订资产管理合同，并按照与资产管理人协商一致的安排，在约定的时间内，将初始委托资产（也即认购资金）足额从在中国境内银行开立的自有银行账户划拨至本计划的募集账户。本计划的募集账户由运营服务机构申万宏源证券有限公司负责开立和管理，信息如下（募集账户名称中数字及符号的输入格式均为中文半角）：

账户名称：申万宏源证券有限公司

银行账号：1219151434102750000000626

开户银行：招商银行股份有限公司北京分行营业部

大额支付号：308100005027

在初始委托资产划付至托管账户之前，任何机构和个人不得将募集账户中的委托人认购资金挪作他用。

募集账户是管理人自行或委托运营服务机构或账户监督机构开立的专用账户，由开立机构负责监督。

3、初始参与份额的计算

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 净认购金额 × 认购费率

本计划不收取认购费用，认购费率为 0%。认购份额 = (净认购金额 + 初始销售期间净认

购金额产生的利息) ÷ 份额初始面值

认购份额计算结果采用四舍五入的方式保留到小数点后2位, 舍弃部分归入本计划财产。

4、认购缴纳款项及利息的处理方式

资产委托人的认购参与款项(不含认购费用)加计其在划入募集账户后至划付至托管账户前期间形成的利息(按照人民银行同期活期存款利率计算)折算为资产管理计划份额归资产委托人所有, 以份额登记机构的记录为准。

5、资产委托人将初始委托资产交付至募集账户后, 资产管理人按照本合同的约定, 将初始委托资产划付至托管账户。资产托管人于托管账户收到初始委托财产后, 进行核实, 核实无误后, 向资产管理人出具资金证明。

6、资产管理人确认委托财产入账后, 出具书面《资产管理计划成立通知书》按照资产委托人、资产托管人认可的途径发送至资产委托人、资产托管人, 告知资产委托人、资产托管人资产管理计划成立。

(六) 计划份额的追加

1、在本资产管理计划存续期内, 本资产管理计划定期开放, 开放日为每周三, 遇节假日顺延至下一工作日。开放日资产委托人有权以书面通知的形式追加计划份额。追加计划份额比照认购初始计划份额办理移交手续。追加计划份额无最低金额要求。

2、参与价格

本计划参与采用金额申请的方式, 追加资产管理计划份额的, 每份资产管理计划份额价格按当期开放日资产管理计划份额净值计算。

3、参与费率

本计划不收取参与费用, 参与费率为0%。

4、追加资产管理计划份额的计算

净追加金额 = 追加金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 净追加金额 × 参与费率

追加份额 = 净追加金额 ÷ 参与价格

在资产委托人追加本资产管理计划时, 根据该公式计算的追加份额保留到小数点后两位, 第三位四舍五入。

5、追加申请的确认

资产管理人于T+2日对于T日申请进行确认。资产管理人应在开放日及时将资产委托人的追加申请和进款流水及时发给运营服务机构做份额登记。

截至开放日 15:00 仍未经资产管理人认可的追加申请, 视为追加失败, 资产管理人应于开放日后 10 个工作日内将资产委托人的全部参与款项退还资产委托人。

6、资产管理人、资产托管人应按照本合同的约定分别管理和托管追加部分的委托财产。资产管理人应及时将资产委托人追加计划份额的书面通知及时发给运营服务机构做估值核算。

7、追加款项划付至托管账户前不计算利息。

(七) 计划份额的提取

1、本资产管理计划定期开放, 开放日为每周三, 遇节假日顺延至下一工作日。开放日, 在不违反相关法律法规、监管规定和员工持股计划规定, 且满足本合同约定条件的情况下, 委托人可以提取计划份额。开放日委托人提取份额的, 应满足下列条件: 当计划资产净值高于 100 万元人民币时, 资产委托人可以提取部分计划份额, 但提取后的剩余计划资产净值不得低于 100 万元人民币; 当计划资产净值少于 100 万元人民币时, 资产委托人不得提取, 但经合同各方当事人协商一致可以提前终止本合同。

2、资产委托人如需要提取计划份额, 应于当期开放日前【5】个工作日将提取申请书交给资产管理人。资产管理人于开放日当日(T日)正式受理提取申请, 资产管理人于 T+2 日对 T 日申请进行确认。

3、提取价格

提取价格以当期开放日资产管理计划份额净值计算。

4、退出费率

本计划不收取退出费用, 退出费率为 0%。

5、提取金额的计算公式

退出费用 = (提取价格 × 提取份额) × 退出费率

提取金额 = 提取份数 × 提取价格 - 退出费用 (如有)

在委托人提取资产管理计划份额时, 根据该公式计算的提取金额保留到小数点后两位。

6、提取款项的支付

(1) 资产委托人提取申请经资产管理人确认后, 资产管理人应在当期开放日后十个工作日内将提取款划入资产委托人指定的账户, 该指定账户应与资产委托人交付委托资产的银行账户一致。

(2) 在提取款项划付完成当日, 即视为就已提取的资产管理计划份额已经完成清算分配; 若资产委托人对提取款有异议, 应在提取款到账后三个工作日内向资产管理人提出书面

意见，否则视为资产委托人完全认同提取款的计算及分配。

7、资产委托人应为管理人预留充足的变现时间，以保证托管账户中的最近足以支付提取金额。

第八章资产管理计划的投资

（一）投资目标

本计划按照法律法规、监管机构以及员工持股计划的规定，最大限度的实现员工持股计划的目的。

（二）投资范围及比例

1、本资产管理计划的投资范围为：

（1）权益类：深圳证券交易所上市的A股股票金科股份（000656）、融资融券。

（2）固定收益类：现金、银行存款、大额存单、货币市场基金、利率债、债券逆回购；如法律法规规定资产管理人需取得特定资质后方可投资某品种，则资产管理人须在获得相应资质并与托管人协商一致，且托管人取得相关投资品种技术支持后开展此项业务。

特别提示：本计划可以参与融资融券交易，可能面临包括但不限于以下风险：

①因资产管理人或本计划自身变化原因导致损失的风险，原因包括但不限于：资产管理人在从事融资融券交易期间，因法律法规规定或监管原因导致资产管理人或本计划被暂停或取消融资或融券资格；资产管理人信用资质状况发生变化导致证券公司降低其授信额度，并由此导致资产管理人不能从事融资融券交易或该资产管理人适用的相关风险控制指标被证券公司单方面提高；因本计划自身原因导致其资产被司法机关或其它有权机关采取财产保全或强制执行措施，或者出现终止、清算情况时，本计划将面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险；因本计划不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险；本计划融资融券交易被证券公司强制平仓或终止时，若参与融资融券交易的担保物不足以清偿证券公司债务的，本计划其他财产面临被证券公司追偿的风险。

②政策风险，包括但不限于：因交易所、监管机关要求或证券公司自身管理需要发生融资融券标的证券范围调整、可充抵保证金证券范围或折算率调整、标的证券暂停交易或终止上市、保证金比例调整、预警线、平仓线指标调整等情况，本计划将可能面临被证券公司限制交易或提前了结融资融券交易的风险；由于国家法律、法规、政策的变化，证券交易所交易规则的修改等原因，可能会对参与融资融券业务的本计划造成经济损失。

③市场风险：在融资融券合同有效期内，证券公司可能调高融资利率或融券费率，本计划将面临融资融券成本增加的风险。

④杠杆风险：融资融券交易与普通证券交易不同，具有财务杠杆放大效应，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

⑤委托人已知悉并同意，若本单一计划参与融资融券业务，只进行融资交易不进行融券交易，并且相关融资款项仅用于购买【金科地产集团股份有限公司（股票代码：000656）】的股票，不得用作其他用途。

⑥委托人已知悉并自愿承担本计划参与融资融券交易的投资风险。当本计划参与的融资融券交易维持担保比例低于《融资融券业务合同》及相关申请文件等约定的平仓线或最低线时，管理人收到融资融券服务提供券商补交担保物通知的当日通过邮件、电话、传真或书面方式中的一种或多种方式通知委托人，委托人应在通知要求的时间内足额追加风险调整资金至托管户，使维持担保比例符合《融资融券业务合同》及相关申请文件等相关约定；如委托人未在通知要求时间内足额追加风险调整资金导致违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。通知的发送以管理人的发送记录为准。

特别提示：若本单一计划参与融资融券交易，委托人知悉并同意相关约定以融资融券服务提供券商与本单一计划签订的《融资融券业务合同》及相关申请文件等为准。如因委托人原因导致本计划在履行《融资融券业务合同》及相关申请文件等过程中违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。

2、本资产管理计划的投资比例为：

(1) 投资于权益类资产占本计划资产总值的比例为 80%-100%；

(2) 投资于固定收益类资产占本计划资产总值的比例为 0-20%。

3、本资产管理计划在中国基金业协会完成备案前不得进行投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

4、资产管理计划符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》组合投资的要求。

(三) 投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合

同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，此种情况不视为违约。

（四）风险收益特征

本计划属于 R4 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C4、C5 的合格投资者及专业投资者。

（五）业绩比较基准测算依据及测算过程

本计划无业绩比较基准。

（六）投资策略

1、决策依据

【通过对国民经济形势和金融市场状况以及金科股份经营环境、经营状况和财务状况的分析和研究而做出相应投资决策】

2、决策程序

【本计划由管理人自行做出投资决定，最终投资决定权属于本计划管理人。】

3、投资管理的方法和标准

【通过二级市场买入并持有深圳证券交易所上市的 A 股股票金科股份（000656）。】

（七）投资限制

本计划财产的投资组合应遵循以下限制（本计划自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制）：

（1）本计划持有金科股份（000656）的市值不得超过该公司总股本的 4.99%，不得超过流通股本的 10%；

（2）本计划不得持有三板股票；

（3）本计划不得参与定向增发。

（4）本计划以委托资产购买的标的股票及其配送股等股票孳息，自建仓期内最后一笔标的股票买入之日起算 12 个月内锁定，不得进行交易。

（5）委托资产的投资应严格遵守法律法规、监管机构、交易所及员工持股计划的规定，不得在法律法规、监管机构、交易所及员工持股计划规定信息敏感期、法定锁定期、归属锁定期（如适用）等限制交易期间内买卖标的股票，不得违反法律法规、监管机构、交易所及员工持股计划规定的持股规模、减持规则等投资限制。

委托人有义务提前 1 个工作日书面通知管理人上述期间和投资限制。若委托人未履行该

通知义务的，管理人不承担违约责任且不承担因该交易导致的或有负面后果。

(6) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%。

(八) 风险控制

1、若任一工作日(T日),经管理人估算的收盘后计划总资产超过本计划净资产的 200%,管理人应于 T+1 日通知委托人于 T+5 日 13:00 以前追加风险调整资金至托管户,以使本计划总资产不超过本计划净资产的 200%。若委托人未能及时足额追加风险调整资金使得本计划总资产不超过本计划净资产的 200%,管理人应在可交易的前提下变现权益类资产,直至本计划总资产不超过本计划净资产的 200%。资产委托人应使用交付委托资产的银行账户划付风险调整资金。

2、当本计划参与的融资融券交易维持担保比例低于《融资融券业务合同》及相关申请文件等约定的平仓线或最低线时,管理人收到融资融券服务提供券商补交担保物通知的当日通过邮件、电话、传真或书面方式中的一种或多种方式通知委托人,委托人应在通知要求的时间内足额追加风险调整资金至托管户,使维持担保比例符合《融资融券业务合同》及相关申请文件等相关约定;如委托人未在通知要求时间内足额追加风险调整资金导致违约或被强制平仓,则全部风险由委托人自行承担。通知的发送以管理人的发送记录为准。

3、风险调整资金仅用于以上两条约定的风险控制之目的,不作为资产委托人对本计划份额的追加,也不做份额登记,追加、提取风险调整资金不受本计划开放日限制。委托人追加风险调整资金当日,应向管理人、托管人提交盖章版《追加风险调整资金函》(附件一)。

当追加风险调整资金后,本计划总资产连续【3】个工作日不超过本计划净资产的【200%】且符合融资融券服务提供券商的提取标准和提取条件时,委托人决定提取风险调整资金的,管理人应于收到委托人提取风险调整书面申请后的【3】个工作日内告知计划运营服务机构及托管人风险调整资金的提取事宜,并向托管人提供风险调整资金提取指令、委托人签名的风险调整资金提取申请书,托管人按照提取指令将相应财产划付至委托人收款账户,委托人收款账户应与资产委托人交付委托资产的银行账户一致。管理人负责判断是否符合融资融券服务提供券商的提取标准和提取条件,托管人收到管理人提交的风险调整资金提取指令时,视为管理人认可该提取已符合融资融券服务提供券商的提取标准和提取条件。

(九) 资产管理计划的建仓期

本计划的建仓期为产品成立之日起【6】个月。建仓期的投资活动,应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征。以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央

银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的不受此限制。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

（十）投资比例超标的特殊情况

本计划为权益类单一资产管理计划，计划存续期间，为规避特定风险，投资于权益类资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。发生本条规定的特殊情况，权益类资产比例低于计划总资产80%时，固定收益类资产占本计划资产总值的比例可以为0-80%。委托人签署本资产管理合同，视为同意上述投资运作约定。

特定风险包括以下风险：

1、特定市场风险。因管理人判断市场行情或近期走势不利于、不兼容、不适合本计划投资策略，若投资于权益类资产的比例超过总资产80%将不利于本计划投资收益的稳定或可能造成本计划而产生的市场风险；

2、特定流动性风险。因管理人判断权益市场行情流动性不足，持仓比例超过80%不利于本计划可能产生流动性的风险，或本计划即将处于开放期、收益分配日、终止日等日期，为应对本计划追加提取计划份额、追加提取风险调整资金、收益分配、清算等需要，管理人有权进行减仓或者平仓操作；

3、特定净值变动风险。为本计划投资风控要求，在满足不同净值区间下，管理人将设置不同持仓比例，以争取确保本计划设置的风控措施能够实现。

（十一）本计划主要投资于交易所交易的股票、固定收益类证券等流动性较高的投资标的，与追加、提取安排相匹配。

（十二）投资范围、投资限制和投资策略的变更

经委托人、管理人和托管人协商一致，可对投资范围、投资限制和投资策略进行变更，应为管理人及托管人调整投资组合变更投资策略留出充足的时间。

（十三）投资禁止行为

本计划财产禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保。
- 3、从事承担无限责任的投资。
- 4、从事内幕交易，操纵证券、期货价格及其他不正当的交易活动。
- 5、法律法规、中国证监会、交易所等机构以及本合同规定禁止从事的其他行为。

(十四) 管理人对计划财产进行管理运作的原则及方法:

- 1、不谋求对上市公司的控股, 不参与所投资上市公司的经营管理。
- 2、有利于计划财产的安全与增值。

管理人按照国家有关法律法规的规定代表计划独立行使股东权利, 保护投资者的利益。

(十五) 关联交易及利益冲突

1、资产管理人可运用计划财产买卖资产管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体发行的证券或承销期内承销的证券、直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品(下称“关联交易”)。但需要遵循资产委托人利益优先的原则、防范利益冲突。

2、本计划可能投资于由资产管理人、托管人或其关联方管理的产品、发行的证券或承销期内承销的证券, 或者与资产管理人、托管人或其关联方管理的其他产品或管理人、托管人自身进行交易, 资产管理人保证其本身及其关联方将遵循公平、公正原则, 平等对待资产管理人及其关联方管理的所有投资产品, 并保证不会在这些产品之间进行利益输送, 公平处理资产管理人及其关联方管理的其他投资产品与本计划的利益冲突。

3、资产委托人签署本合同即表明其已经知晓并同意本计划可能进行上述关联交易。

4、管理人有义务在本合同成立日当日或最迟于本合同成立日的【次日】(本条款的“日”指自然日)将其关联方名单提供给托管人, 若管理人未在上述期限内向托管人提供其关联方名单的, 即视为管理人不存在关联方, 由此导致的任何风险或责任由管理人自行承担; 管理人有义务在其关联方发生变更时以电子邮件或双方约定的其他方式及时通知托管人。管理人应自行确保关联方名单的真实性、准确性与完整性。若因管理人提供的关联方名单不及时、不真实、不准确、不完整, 导致托管人无法进行投资监督或引起其他风险/责任的, 由管理人承担相关责任。

5、托管人有义务在本合同成立日当日或最迟于本合同成立日的【次日】(本条款的“日”指自然日)将其关联方名单提供给管理人, 若托管人未在上述期限内向管理人提供其关联方名单的, 即视为托管人不存在关联方, 由此导致的任何风险或责任由托管人自行承担; 托管人有义务在其关联方发生变更时以电子邮件或双方约定的其他方式及时通知管理人。

(十六) 其他

本计划进行投资时, 管理人可以以管理人的名义代表本计划与交易对手方签订投资协议, 管理人应在各类投资协议中明确是代表本计划投资, 且应在各类投资协议中明确约定该项投资收益款项的回款账户为本计划托管账户; 投资协议为格式文本无法修改的, 管理人应与各

交易相关方拟定补充协议或向其出具说明函,明确原投资协议与本计划的直接关系。管理人未提供符合以上约定的投资协议、补充协议或说明函的,托管人有权拒绝执行投资指令,由此造成的损失由管理人负责。

第九章 利益冲突及关联交易

(一) 资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形。

本资产管理计划可能投资于管理人、托管人、投资顾问(如有)及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等关联方发行的证券或承销期内承销的证券、直接或间接管理的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品、或者从事其他重大关联交易的,但管理人不得将其管理的资产管理计划资产投资于其管理的其他资产管理计划,依法设立的基金中基金资产管理计划以及中国证监会另有规定的除外。管理人确认其已建立防范利益输送和利益冲突的机制,确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行。但该等交易仍构成管理人与本资产管理的关联交易,存在利益冲突风险。

(二) 资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率。

1、管理人可运用委托财产买卖管理人、托管人和/或投资顾问及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等关联方发行的证券或承销期内承销的证券、直接或间接管理的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品、或者从事其他重大关联交易的,但管理人不得将其管理的资产管理计划资产投资于其管理的其他资产管理计划,依法设立的基金中基金资产管理计划以及中国证监会另有规定的除外。管理人应当遵循委托财产利益优先的原则、防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,并向投资者充分披露信息。管理人承诺不以计划产品的资金与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场,包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。

2、资产委托人签署本合同即表明其已经知晓本计划可进行上述关联交易。资产委托人不得因本计划投资收益劣于管理人、投资顾问(如有)及其关联方管理的其他类似投资产品,而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

(三) 运用受托管理资产从事关联交易的,管理人将按照相关法律法规、证监会规定及本合同的约定,及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。运用受托管理资产从事重大关联交易的,应事先取得投资者同意,并有充分证据证明未损害投资者利益。

第十章 投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

本资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。本资产管理计划的投资经理为廖永国。

廖永国毕业于南开大学物理学院，先后获学士和硕士学位；具有10年股票二级市场和期货市场投资管理经验，擅长在价值投资的基础上把握资本市场的中长期趋势性投资机会。在宏源期货有限公司先后担任稳健系列部分产品、安鑫系列、宏智百分1号FOF、宏智百分2号FOF和宏远8号等产品的投资经理；无兼职。廖永国已具备基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理变更的条件及程序

资产管理人可根据业务需要单方面变更投资经理，资产管理人在变更投资经理时，应提前【3】个工作日以书面形式向资产委托人征询意见。资产委托人在收到书面通知后【2】个工作日内以书面形式向管理人予以确认或否认。资产委托人确认的，资产管理人应在收到资产委托人确认后，2个工作日内告知资产托管人，并将管理人的征询意见文件及资产委托人的书面回复文件发送资产托管人留存。资产委托人否认的，资产管理人在收到否认回复后，应及时与资产委托人协商，协商达成一致的，应形成由资产管理人、资产委托人共同签署的书面文件，资产管理人应在2个工作日内告知资产托管人，并将协商一致的书面文件发送资产托管人流程；协商不成的，资产委托人可提起终止合同的书面提议，经资产委托人、资产管理人、资产托管人三方协商一致后，可终止合同。因前述原因终止合同的，因终止合同导致的损失由资产委托人自行承担。协商期间，投资经理仍由原投资经理担任。

第十一章 投资指令的发送、确认和执行

（一）资产管理人对发送指令人员的书面授权

资产管理人应当在本计划成立运作前向资产托管人提供划款指令授权通知书（简称“授权书”），授权书中应包括被授权人的姓名、权限、电话、电子邮件地址、预留印鉴和签字样本、启用日期等。

资产管理人向资产托管人发出的授权书应加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。资产管理人应将授权书的扫描件通过管理人服务系统发送托管人。资产管理人使用管理人服务系统确实有困难的，在征得资产托管人同意后，可以通过电子邮件向托管人发送授权书扫描件，但资产管理人应使用本合同“第

四章当事人及权利义务”中管理人联系人的邮箱或管理人在管理人服务系统设置的用户管理员绑定的邮箱发送电子邮件，其他邮箱发送的，视为无效发送。电子邮件发送后，资产管理人应通过电话方式与资产托管人确认。与扫描件一致的授权书的正本应于管理人服务系统或电子邮件发送提交后五个工作日内送交资产托管人。正本与扫描件不一致的，以扫描件为准，管理人对由此带来的风险和损失承担责任，托管人有权要求管理人提供与扫描件一致的授权书正本。授权通知自资产托管人收到与扫描件一致的正本原件后，方视为通知最终送达。资产管理人未在本合同约定的时间内提供与扫描件一致的授权书正本的，资产托管人有权暂停部分或全部托管服务。

授权书须载明授权生效日期，授权书自授权书扫描件载明的生效日期开始生效。通过管理人服务系统发送授权书扫描件的，托管人在管理人服务系统授权确认的日期晚于载明的生效日期或授权书未载明生效日期的，以托管人在管理人服务系统授权确认的日期开始生效；通过电子邮件发送授权书扫描件的，托管人收到邮件并电话确认的日期晚于载明的生效日期或授权书未载明生效日期的，以托管人收到邮件并电话确认的日期开始生效。

资产管理人在管理人服务系统进行电子划款指令授权的，应与纸质授权书一致。若电子划款指令授权与纸质授权书不一致的，资产托管人有权驳回该电子划款指令授权，由此造成的损失由资产管理人承担。

资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二）指令的内容

指令是资产管理人在运作资产管理计划资产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项收付的划款指令，包括付款指令及其他资金划拨指令等。

资产管理人发给资产托管人的指令应写明收付款人名称、开户行、账号、划款日期、划款金额、划款用途等要素信息。

指令分为两种形式：（1）资产管理人通过资产托管人的管理人服务系统生成的电子划款指令；（2）划款指令书。提交纸质划款指令书的，应加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。

资产管理人通过资产托管人的管理人服务系统提交场外投资的电子划款指令的（包括但不限于：投资商业银行理财产品、信托计划、证券公司（含子公司）资产管理计划、保险资产管理计划、期货公司（含子公司）资产管理计划、基金公司（含子公司）资产管理计划、私募基金等，以及进行股权投资、通过指定银行发放委托贷款等），除划款指令外，资产管

理人还需向资产托管人提供：

1、当事人各方均已签署的投资交易相关文件（包括但不限于：信托合同、投资合同、委托贷款合同、委托人投资确认书等投资相关文本）；

2、收款账户证明文件；

3、资产托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。

如资产管理人因场外投资在管理人服务系统提交电子划款指令的，上述文件应作为电子划款指令的附件通过管理人服务系统提交；如资产管理人通过传真、电子邮件等方式提交划款指令书扫描件的，应通过传真或电子邮件发送扫描件的方式提交上述文件。

资产管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。交易文件应载明真实的资金来源为本计划，并明确上述产品到期或赎回后本金及收益将返回至本计划托管资金账户，如确有真实原因致使交易文件不能载明上述内容的，资产管理人应在上述投资到期或产品赎回/终止后将本金及收益返回至本计划托管资金账户。如果资产管理人无法提供上述交易文件的，资产托管人有权拒绝执行投资划款指令，由此造成的损失由资产管理人负责并承担。资产管理人应确保上述交易文件的始终有效性、真实性、完整性、准确性。本计划投资的产品资产管理人或投资顾问为本计划的资产管理人的，资产管理人承诺不进行任何利益输送的行为；在持有上述产品期间，上述产品的交易文件有任何变更的，资产管理人应负责审查同意该变更的行为不得损害本计划投资者实际利益；在持有上述产品期间，资产管理人对上述产品不得进行抵押、质押、非交易过户或其他任何有损本计划投资者利益的行为。

本合同对拟投资标的的进行穿透约定的（例如投资某基金，对该基金的投向或如何运作进行约定），以该投资标的的交易/法定文件的具体约定为准，但资产管理人仍应确保本计划合同中穿透约定内容的真实性、准确性和完整性。资产管理人负责审查本合同穿透约定与该投资标的的交易/法定文件的具体约定是否一致，如不一致但仍向资产托管人发出投资划款指令的，资产管理人保证该不一致不损害份额持有人的利益。资产托管人仅根据投资划款指令进行划款。上述事项的审核义务由资产管理人负责，由此导致的损失由资产管理人承担。

（三）指令的发送、确认和执行的时间及程序

指令由授权书确定的被授权人代表资产管理人用传真、电子邮件发送扫描件的方式或通过资产托管人管理人服务系统或其他资产管理人和资产托管人认可的方式向资产托管人发送。资产管理人原则上应通过管理人服务系统以电子划款指令形式向资产托管人发送指令（资产管理人审批人审批通过即视为发送，指令内容和发送时间以管理人服务系统为准），发送电子划款指令确有困难的，资产管理人应在与资产托管人协商后采用传真或电子邮件发

送扫描件方式发送划款指令书。

资产管理人通过传真或电子邮件发送扫描件方式发送划款指令书的,资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以电话的方式进行确认。传真、电子邮件以获得资产托管人确认该指令已成功接收之时视为送达。因资产管理人未能及时与资产托管人进行指令确认,致使资金未能及时到账所造成的损失,资产管理人承担责任。资产管理人通过管理人服务系统发送电子划款指令的,应在指令跟踪界面查看指令是否完成。因资产管理人未跟踪指令完成情况,致使资金未能及时到账所造成的损失,资产管理人承担责任。对于被授权人依照“授权通知”发出的指令、以及资产托管人依照资产管理合同约定及授权书规定的方法确认有效的指令,资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照法律法规、行业自律规则和本合同的规定,在其合法的经营权限和交易权限内发送指令,被授权人应按照其授权权限发送指令。资产管理人在发送指令时,应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。因资产管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间,致使资金未能及时到账所造成的损失,资产管理人承担责任。除需考虑资金在途时间外,资产管理人还需为资产托管人留有2小时的复核和审批时间。在每个工作日的13:00以后接收资产管理人发出的银证转账、银期转账划款指令的,资产托管人不保证当日完成划转流程;在每个工作日的14:30以后接收资产管理人发出的其他划款指令,资产托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

资产托管人收到资产管理人发送的电子划款指令后,应审查指令的要素是否齐全。资产托管人在收到资产管理人发送的划款指令书扫描件后,应对指令的形式有效性进行审查,验证指令是否由有权签发指令人员签发、指令的书面要素是否齐全、印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本表面相符、收款账户是否与约定的收款账户一致。审查无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行,不得延误。审查发现存在异议或不符的,应立即与资产管理人进行电话联系和沟通,并要求资产管理人重新发送经修改的指令。资产托管人可以要求资产管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料,以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。发生银行间市场交易的,资产管理人应将银行间市场成交单加盖印章后提供给资产托管人。

有效划款指令须满足以下要件:(1)该指令的经办人、复核人、审批人(以下统称“指令发送人员”)均已获得资产管理人授权且其操作未超出授权范围,且经办人与复核人不为同一人(复核人与审批人可为同一人);(2)指令要素(包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、收款人开户行、金额(大、小写)、款项事由、支付时间)准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全。(3)划款金额不超过付款账户的余额;(4)资产管理合同已

就具体划款事宜约定收款账户的，实际收款账户应与约定的收款账户一致。（5）不得违反法律法规、监管规定、行业自律规则规定、资产管理合同约定。

资产托管人仅根据资产管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，资产管理人对其真实性承担责任。资产管理人应保证发送指令同时提交的其他文件合法、真实、完整和有效。如因资产管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响资产托管人的审核或给任何第三人带来损失，资产管理人承担责任。

如本计划进行场外投资，资产托管人仅根据资产管理人发送的符合本合同约定的划款指令及投资主协议进行资金划付。其他与该投资相关的从协议或与履约保障有关的协议或决议（以下简称“从协议”，包括但不限于：股东会决议、担保协议、保证协议、抵押协议等协议）的签订及生效属于资产管理人的投资管理职责，由资产管理人自行控制，不构成资产托管人执行资产管理人划款指令的必要前提条件。投资者签署本计划合同即视为已知悉相关风险并同意上述安排。

资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保托管账户及其他账户有足够的资金余额，对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人有权拒绝执行，并立即通知资产管理人。

本合同项下的托管账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由托管账户开户银行直接从托管账户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。

资产托管人应当事先向资产管理人提供接受资产管理人指令的人员及联系方式。资产托管人更改接受资产管理人指令的人员及联系方式，应至少提前1个工作日以传真或电子邮件发送扫描件方式发送资产管理人或通过基金综合管理平台通知资产管理人。

（四）资产管理人撤回指令的处理程序

资产管理人撤回已发送至资产托管人的有效指令的，须通过邮箱、传真、管理人服务系统或其他资产托管人认可的方式，向资产托管人发送加盖管理人公章的书面说明函或者注明撤销原因并加盖管理人公章的拟撤回指令，同时向资产托管人电话确认，资产托管人收到说明函或注明撤销原因的指令并得到确认后，资产管理人已发送至资产托管人的指令撤回并作废；如果资产托管人在收到说明函或注明撤销原因的指令并得到确认时该指令已执行，资产管理人承担因为执行该指令而造成损失的责任。

（五）资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规、行业自律规则的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知资产管理人纠正，资产管理人

收到通知后应及时核对、改正，并以书面形式对资产托管人发出回函确认或重新发送指令，由此暂缓或拒绝执行造成的损失由资产管理人承担。

（六）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息有误、模糊不清或不全等。资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。但资产托管人因执行资产管理人的合法指令而对资产管理计划财产造成损失的，资产管理人承担责任。因资产托管人执行资产管理人的依据交易程序已经生效的指令对资产管理计划资产造成的损失，由资产管理人承担相关责任。

（七）更换被授权人的程序

资产管理人更换被授权人的(包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签字样本的修改等)，应当至少提前1个工作日通过管理人服务系统将变更后的授权书的扫描件发送资产托管人。资产管理人使用管理人服务系统确实有困难的，在征得资产托管人同意后，可以通过电子邮件向托管人发送变更后的授权书扫描件，但资产管理人应使用本合同“第四章当事人及权利义务”中管理人联系人的邮箱或管理人在管理人服务系统设置的用户管理员绑定的邮箱发送电子邮件，其他邮箱发送的，视为无效发送。电子邮件发送后，资产管理人应通过电话方式与资产托管人确认。被授权人变更后的授权书应为变更后的完整授权，且由资产管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。资产管理人应在管理人服务系统提交或电子邮件发送变更后的授权书之日起五个工作日内将与扫描件一致的变更后的授权书的正本送交资产托管人。正本与扫描件不一致的，以扫描件为准，管理人对由此带来的风险承担责任，托管人有权要求管理人提供与扫描件一致的变更后的授权书正本。变更后的授权书自资产托管人收到与扫描件一致的正本原件后，方视为通知最终送达。资产管理人未在本合同约定的时间内提供与扫描件一致的变更后的授权书正本的，资产托管人有权暂停部分或全部托管服务。

资产管理人应同时在资产托管人的管理人系统中进行相应授权权限变更，并确保变更后的电子划款指令授权与纸质的变更后的授权书一致。若电子划款指令授权与纸质的变更后的授权书不一致的，资产托管人有权驳回该变更，由此造成的损失由资产管理人负责并承担。

变更后的授权书自扫描件载明的生效日期起开始生效。通过管理人服务系统发送变更后的授权书的，托管人在管理人服务系统变更授权确认的日期晚于载明的生效日期或变更后的授权书未载明生效日期的，以托管人在管理人服务系统变更授权确认的日期开始生效。通过

电子邮件发送变更后的授权书扫描件的,托管人收到邮件并电话确认的日期晚于载明的生效日期或变更后的授权书未载明生效日期的,以托管人收到邮件并电话确认的日期开始生效。变更后的授权书生效后,原授权文件同时废止。被授权人变更通知生效前,资产托管人仍应按原约定执行指令,资产管理人不得否认其效力。被授权人变更通知生效后,对于已被撤换的人员无权发送的指令,或新被授权人员超权限发送的指令,资产管理人不承担责任。

(八) 指令的保管

指令若以电子指令形式提交,则以电子数据的形式保管。指令若以传真或电子扫描件形式发出,则正本由资产管理人保管,资产托管人保管指令传真件或电子扫描件。当两者不一致时,以资产托管人收到的指令传真件或电子扫描件为准。

(九) 相关责任

对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。在遵循本合同约定的正常业务受理渠道及指令预留处理的时间内,因资产托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的指令而导致资产管理计划财产受损的,资产托管人应承担相应的责任,但托管账户及其他账户余额不足或资产托管人遇到不可抗力的情况除外。

如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供发送指令人员的预留印鉴和签字样本等非资产托管人原因造成的情形,资产管理人承担由其造成的损失,但资产托管人未尽审核义务执行指令而造成损失的情况除外。

第十二章 交易及清算交收安排

(一) 选择证券经纪机构及证券投资资金清算安排

1、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

(1) 管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构,并与其签订证券交易委托代理协议。

(2) 管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人。

(3) 如果资产托管人与资产管理人选择的担任本计划财产证券买卖的证券经纪机构为同一机构,资产管理人、资产托管人(证券经纪机构)无需就本计划参与证券交易的具体事

项另行签订协议，资产管理人和资产托管人（证券经纪机构）应根据证券经纪合同和本协议的约定履行本计划进行证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。本计划在证券交易所进行证券买卖的交易单元号、交易费率等事项由资产管理人在资产托管人（证券经纪机构）指定分支机构开立证券交易资金账户时约定。

2、证券交易数据发送和接收

本资产管理计划的证券交易数据传输具体操作及时间要求按照管理人、托管人及证券经纪商签订的相关协议或操作备忘录的约定执行。

3、证券交易的资金清算与交割

（1）证券交易资金的清算

管理人的投资指令执行后，因本资产管理计划投资于证券发生的所有二级市场交易的清算交割，由管理人选择的证券经纪商负责办理。

（2）资金结算

资产托管人、资产管理人应共同遵守按中国人民银行、中国银监会、中国证券登记结算有限公司、交易所的有关规定办理，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

资产管理人在投资之前，应充分知晓与理解各类交易品种的结算业务规则 and 规定。

证券经纪机构代理本计划财产与中国证券登记结算有限公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由资产管理人承担。

（3）如果资产托管人与资产管理人选择的担任本计划财产证券买卖的证券经纪机构为同一机构，资产托管人为完成本计划会计核算、估值、清算、监督职能与证券经纪机构进行的证券交易所、登记结算公司场内交易电子数据传输、核对事宜由资产托管人（证券经纪机构）负责基金托管、经纪业务（含证券营业部）的相关部门商定，并根据证券经纪合同和本协议的约定办理。当核对T日交易清算金额发现证券清算差异小于1.00元的，不查差异原因，以资产托管人（证券经纪机构）经纪业务部门提供的对账单为准；当证券清算差异大于（含等于）1.00元的，资产托管人（证券经纪机构）发现问题后应即刻通知资产管理人共同查明原因并消除差异。因证券交易所、登记结算公司及资产托管人（证券经纪机构）无法控制的其他原因造成数据传输错误或不及时的，由过错方承担责任。

（4）对于任何原因发生的证券交收违约事件，相关各方应该及时协商解决。

4、清算交割处理

资金划转的方式在符合银行资金结算的有关规定的情况下可由托管人和管理人共同商

定。

（二）选择场内期权经纪机构及场内期权投资资金清算安排

一般情况下，管理人应选择其聘请的证券经纪机构作为其场内期权经纪商；在此情形下，场内期权交易数据发送和接收、资金清算与交割按照本章节第一条相关约定进行处理。

若管理人聘请其证券经纪机构以外的机构作为其场内期权经纪商的，应就场内期权交易数据发送和接收、资金清算与交割事宜与场内期权经纪商、托管人另行签署书面协议。

（三）选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

本资产管理计划投资于期货前，资产管理计划管理人负责选择为本资产管理计划提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。资产管理计划管理人、资产管理计划托管人和期货公司可就资产管理计划参与期货交易的具体事项另行签订协议。本资产管理计划的交易数据传输具体操作及时间要求按照管理人、托管人及期货经纪商签订的相关协议或操作备忘录的约定执行。

本资产管理计划投资于期货发生的资金交割清算由资产管理计划管理人选定的期货经纪公司负责办理，资产管理计划托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，资产管理计划管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

（四）关于银证、银期、银行、银信转账等特殊安排

管理人不得自行通过交易客户端进行银证、银期、银行、银信转账操作。

如管理人对银证、银期、银行、银信转账密码进行修改，管理人需每次在划款指令中注明有效转账密码，管理人承担保管转账密码的职责；因管理人未能在指令中注明有效转账密码，而造成的出入金、保证金、交易等业务的影响，管理人承担责任。

（五）银行间债券市场交易的清算和交收

对于银行间债券市场交易的确认和资金的交收，由管理人根据本合同的约定出具划款指令，并提供交易确认和资金交收的依据，该依据包括但不限于银行间市场债券分销协议、银行间市场交易成交单等，管理人对相关依据加盖公章或业务章并经托管人审核通过后，完成银行间债券市场交易的确认和资金的交收。

托管人通过银行间债券市场资金交收平台完成银行间债券市场交易的最终清算和交收。

（六）场外交易的清算和交收

1、对于本章节第（一）条至第（四）条所述场所外的交易的清算和交收，以及相关费用的支付，除本合同另有约定外，按照下述约定执行：

由管理人按照本合同的约定出具划款指令,由资产托管人凭资产管理人符合本合同约定的划款指令和交易证明文件进行资金划拨。资产管理人保证所提供的以上交易证明文件的真实性和有效性。

资产管理人应于划款前提供已签署的交易证明文件以及划款指令,并以书面形式通知资产托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。上述相关合同、协议中约定的其他划款条件由管理人负责审核并承担相应后果。

资产管理人应指定本计划的托管资金账户为本计划投资所产生的本金、利息、投资收益以及其他收益的唯一收款账户。

2、开放式基金认购、申购、赎回的交易安排

管理人与托管人在办理开放式基金认购、申购、赎回中的权利、义务、职责遵照有关法律法规规定执行。

管理人申购(认购)开放式基金时,应将划款指令连同基金申购(认购)申请单按本合同“投资指令的发送、确认和执行”章节的约定发送至托管人。托管人审核无误后,应及时将划款指令交付执行,并对划款指令执行情况进行查询,将执行结果通知管理人。管理人应及时向基金公司或第三方代销机构索取开放式基金申购(认购)确认单并在收到后传真给托管人,以作为双方进行会计核算的依据。

管理人赎回开放式基金时,应同时向基金管理公司或代销机构和托管人发出基金赎回申请书。管理人应及时向基金公司或第三方代销机构索取开放式基金赎回确认单,并发送给托管人,以作为双方进行会计核算的依据。对于因基金管理公司不能在约定的时间提供开放式基金交易确认凭证、分红凭证、拆分数据等,致使托管人在估值日缺乏必要的核算依据而造成的资产核算和估值差错,由管理人或基金管理公司承担相关责任。

(七) 无法按时清算的责任认定及处理程序

资产管理人应保证资产托管人在执行资产管理人发送的指令时,本计划托管账户上有充足的资金。资金头寸不足时,资产托管人有权拒绝资产管理人发送的资金划拨指令但应及时通知管理人,并视托管账户资金余额足够时为指令送达时间。资产管理人在发送资金划拨指令时应充分考虑资产托管人的划款处理时间,一般除需考虑资金在途时间外,还需预留2小时的复核和审批时间。银证转账、银期转账划款指令的送达时间为划款日期(以划款指令书为准)的13:00前;其他划款指令的送达时间为划款日14:30前。如指令逾期送达或未能留出足够的执行时间,资产托管人不保证在划款日内完成划款。由于指令传输不及时、未能留出足够的划款时间,致使资金未能及时到账所造成的损失,由管理人承担相关责任。在资

资产管理计划财产资金头寸充足的情况下,资产托管人对资产管理人符合法律法规、行业自律规则和本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行。如由于资产托管人的故意或重大过失导致资产管理计划财产无法按时支付投资款项,由此造成的损失由资产托管人承担,但资产托管人遇到不可抗力情况除外。

(八) 资金、证券等账目及交易记录的核对

1、资金、证券等账目的核对

对资产管理计划财产的资金、证券等账目,以资产管理人与资产托管人约定方式核对,确保相关各方账账相符。

2、交易记录的核对

资产管理人定期进行交易记录的核对。在与资产托管人核对估值结果之前,资产管理人必须保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致,造成会计核算不完整或不真实,由此导致的损失由资产管理人承担。

(九) 追加、提取计划份额的资金清算和数据传递的时间、程序

1、资产管理计划份额追加、提取的确认及清算由资产管理人或其委托的份额登记机构负责。

2、资产管理人或其委托的份额登记机构应将每个开放日的追加、提取数据传送给资产托管人。资产管理人应对传递的追加、提取数据的真实性、准确性、完整性负责。资产托管人应及时查收追加资金的到账情况并根据资产管理人指令及时划付提取款项。资产管理人或其委托的份额登记机构未及时向资产托管人传送开放日追加、提取数据的,由此造成的后果,由管理人承担相关责任。

3、资产管理人应在T+3日(T指追加申请日)前将追加净额(不包含参与费)划至托管账户。如追加净额未能如期到账,资产托管人应及时向资产管理人催收,由此给本计划造成损失的,由责任方承担。资产管理人负责向责任方追偿本计划的损失。

4、资产管理人应在T+8日(T指赎回申请日)之前向资产托管人发送提取资金的划拨指令,并保证托管账户预留足额资金。资产托管人依据指令在T+9日内将提取资金(不含提取产生的应付费用)划至本计划募集账户。若提取金额未能如期划拨,由此造成的损失,由责任方承担。资产管理人负责向责任方追偿本计划的损失。

(十) 其他

因投资运作需要由管理人自行为本产品开立交易账户的,管理人须于该账户进行交易前以邮件或其他双方认可的方式告知托管人,并确保相关交易数据及时、准确的发送给托管人。

第十三章越权交易

（一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下资产委托人的授权而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事投资。

（二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，有权拒绝执行，有权通知资产管理人并有权报告中国证监会。

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，有权通知资产管理人并有权报告中国证监会。

资产管理人应向资产委托人和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，资产委托人和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产委托人和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人有权报告中国证监会。

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

资产托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决，由此给资产托管人及资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。如果因非资产托管人的原因发生超买行为，资产管理人必须于超买日次一交易日上午 10:00 前完成融资，确保完成清算交收。

- 3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人的投资监督

- 1、托管人按照法律法规规定及本节约定对管理人的投资行为行使监督权，托管人对资产管理计划财产的监督和检查自本资产管理计划成立日起开始。

- (1) 本合同第十一章资产管理计划的投资是托管人实施投资监督的依据，托管人就该

章节中约定的由托管人监督的事项对投资运作进行监督,托管人按照该章节的约定履行了相应义务即完成了本合同项下的监督义务。

受监督手段所限,托管人对以上章节列明的场内品种投资进行盘后监督,而非实时监督、管控。因管理人未依照以上章节进行投资给本资管计划托管财产或者合伙人造成财产损失的,管理人承担责任。

(2) 对于场外品种的投资,托管人将在划款前根据本合同“投资指令的发送、确认与执行”章节对相应的投资指令、投资申请书、投资协议等管理人所提供的材料是否符合投资范围、投资限制进行形式审核。场外投资是指除投资于上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统、上海黄金交易所、中国金融期货交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、上海国际能源交易中心等国家法律认可的股票、期货、现货交易所挂牌交易的品种之外的投资。

(3) 托管人在投资监督职责范围内,发现产品运作中有不符合合同约定或者达到合同约定的条件时,托管人拟定《违规提示函》通过电子邮件或其他约定的方式通知管理人。

2、管理人自行承担对于本合同“投资风险控制”章约定的风险控制机制的执行情况进行监督的职责。

3、托管人负责保管本计划项下托管账户内的现金资产,对于本计划项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产(包括现金类资产与非现金类资产),管理人承担保管职责。

4、托管人对于本计划投资收益分配(如有)承担的复核职责仅限于**对收益分配(如有)的总金额进行复核**。

5、对于需要外部市场公共数据支持才可以实现的投资监督,托管人不保证外部数据的真实、完整、准确,因外部数据提供商提供数据存在瑕疵导致计划财产的损失,由过错方承担相关责任。

6、资产委托人确认,托管人的投资监督职责以本合同约定为限,且托管人投资监督的准确性和完整性受限于证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息,合规投资的最终责任在管理人。

托管人对管理人投资运作的监督,以投资政策及经管理人与托管人核对确认的核算估值结果为根据。

(四) 越权交易的例外

非因资产管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易,应当属于被动超标,因被动超标而对资产管理计划财产造成的损失由资产管理计划财

产承担：

1、由于资产管理人之外的原因导致的投资比例（如有）出现不符合本合同约定的投资政策的情形为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于市场价格波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定。发生被动超标时，管理人应在相应证券可交易之日起十五个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求。因证券停牌或其他非管理人可以控制的原因除外。

2、本合同终止前十个交易日内，资产管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现，由此造成投资比例（如有）、投资范围不符合投资政策规定的，视为被动超标，不属于越权交易。

3、法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

第十四章 资产管理计划资产的估值与会计核算

（一）估值

1、估值目的：

客观、准确地反映计划资产的价值。

2、估值时间

资产管理人与资产托管人于每个工作日对计划财产进行估值，T+1日完成T日估值核对。

3、估值对象

资产管理计划所拥有的资产及负债。

4、估值方法

（1）银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

（2）证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

B、交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境

发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

C、交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

D、交易所上市不存在活跃市场的其他有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 处于特定期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值。

B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

C、流通受限股票，按以下方法估值：

流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：FV为估值日该流通受限股票的价值；S为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由中证指数有限公司或者中央国债登记结算有限责任公司发布提供。

(4) 证券投资基金估值方法：

A、上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近一个交易日的收盘价估值；

B、场外认购或申购的开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金LOF）以估值日前一工作日基金净值估值，估值日前一工作日开放式基金份额净值未公布的，以前最近一个工作日基金份额净值计算。

C、货币基金以成本列示，按前一交易日的每万份收益计提红利。

(5) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况，在与托管人商议后，

按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

管理人及其指定的估值核算资料提供方提供的数据提供错误或不及时造成估值结果有误或延误的，由造成过错的一方自行承担由此产生的后果和影响。当采用上述会计原则进行估值核算处理后，托管人视为完全履行了计划合同约定的估值核算相关义务，若因此造成计划财产和计划份额持有人重大损失的，由管理人代表本资产管理计划向责任方追偿。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

5、估值程序

(1) 本计划资产份额净值保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由本计划资产承担。国家另有规定的，从其规定。

(2) 管理人、托管人应定期对计划资产净值进行核对。计划资产净值是指计划资产总值减去负债后的价值，计算保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入；份额的计算保留到小数点后二位，小数点后第三位四舍五入。

6、估值差错处理

如管理人或托管人发现资产估值违反本合同约定的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

根据有关法律法规，本计划资产的会计责任方由管理人担任，因此，就与本资产有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以管理人的意见为准，但管理人需尽善良、谨慎的合理注意义务，确保相关会计问题以及估值方式、方法和程序符合相关法律法规的规定，合法、公允。

当计划资产估值出现错误时，管理人和托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到组合资产净值的0.5%时，管理人应该立即报告委托人，并说明采取的措施，立即更正。如资产管理人和资产托管人对组合资产净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时，为避免不能按时披露组合资产净值的情形，以资产管理人的计算结果对外披露，由此给资产委托人和委托财产造成的损失，资产托管人予以免责。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致计划财产净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后交易日

计划财产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于交易所及其注册登记公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的计划资产估值错误,资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

7、估值调整的情形与处理

本计划不存在估值调整的情形。

8、暂停估值的情形

(1) 计划投资所涉及的交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。

(2) 因不可抗力或其他情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时。

(3) 占计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而管理人为保障资产委托人的利益,决定延迟估值时。

(4) 出现紧急事故,导致管理人不能出售或评估计划资产时。

(5) 中国证监会认定的其他情形。

9、资产管理计划份额净值的确认

用于向委托人报告的计划份额净值由管理人负责计算,托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照管理人对计划资产净值的计算结果为准。

10、特殊情况的处理

(1) 资产管理人按本合同约定的按照公允价值进行估值时,所造成的误差不作为计划份额净值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因,或由于交易场所及注册登记公司发送的数据错误,资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的计划财产估值错误,资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(二) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行:

1、资产管理人为本计划的主要会计责任方。

- 2、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- 3、本计划的记账本位币为人民币，以人民币元为记账单位。
- 4、会计核算制度执行国家有关会计制度。
- 5、本计划单独建账、独立核算。
- 6、资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照本合同约定编制会计报表。
- 7、资产托管人定期与资产管理人或运营服务机构就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

第十五章 资产管理业务的费用与税收

（一）与本计划运作有关的费用

- 1、资产管理人收取的管理费；
- 2、资产托管人收取的托管费；
- 3、本计划发生的运营服务费；
- 4、本计划投资交易费用；
- 5、本计划相关账户开立费用（包括但不限于银行账户、证券账户）；
- 6、本计划银行账户维护费用、银行账户汇划费用以及网银服务费、管理费、数字证书年费等相关费用；
- 7、本计划管理及资产管理计划财产投资运作过程中产生的审计费、评估费等聘请中介机构费用以及保险费、公证费及其他费用；
- 8、本计划终止时的清算费用；
- 9、为解决因资产管理计划财产及本计划事务产生的纠纷而产生的费用，包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费、拍卖费以及其他形式的资产处置等费用；
- 10、按照法律法规、行业自律规则的规定及本合同的约定可以在资产管理计划财产中列支的其他费用。

（二）不得列入资产管理计划财产的费用项目

- 1、资产管理计划成立前发生的费用，不得在计划资产中列支。
- 2、资产管理人、资产托管人、资产管理人委托的外包服务机构因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

(三) 本计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的管理费

本计划的管理费年费率为【0.26%】，始终按资产管理计划前一日实收资本的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的资产管理计划管理费

E为资产管理计划前一日实收资本

资产管理人的管理费自本计划成立日起，每日计提，逐日累计，按季支付。资产管理人在此授权资产托管人于每自然季次月的前十五个工作日之内或本计划终止时，将管理费从资产管理计划财产中支付至资产管理人如下账户，资产管理人无需再出具管理费划款指令：

资产管理人账户名称：宏源期货有限公司

资产管理人账号：0200004619200058968

资产管理人开户银行名称：工商银行北京公主坟支行

大额支付号：102100000466

费用扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

2、资产托管人的托管费

本计划托管费年费率按【0.2%】计算，无年度最低收费金额限制。

本计划托管费始终按资产管理计划前一日实收资本的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的本计划托管费

E为资产管理计划前一日实收资本

资产托管人的托管费自本计划成立日起，每日计提，逐日累计，按季支付。

资产管理人在此授权资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，于每自然季次月的前十五个工作日之内或本计划终止时或资产托管人变更时，将托管费从资产管理计划财产中支付至资产托管人指定账户，资产管理人无需再出具托管费划款指令。费用扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

资产托管人的托管费收费账户信息如下：

账户名称：申万宏源证券有限公司

银行账号：11001085200059507005

开户行：建行北京丰盛支行

大额支付号：105100003138

3、本计划运营服务费

本计划运营服务费年费率按【0.2%】计算，无年度最低收费金额限制。

本计划运营服务费始终按资产管理计划前一日实收资本的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times \text{年运营服务费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的运营服务费用

E为资产管理计划前一日实收资本

本计划的运营服务费自本计划成立日起，每日计提，逐日累计，按季支付。

资产管理人在此授权资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，于每自然季次月的前十五个工作日之内或本计划终止时或运营服务机构变更时，将运营服务费从资产管理计划财产中支付至资产管理计划运营服务机构收款账户，资产管理人无需再出具运营服务费划款指令。费用扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

运营服务机构的运营服务费收费账户信息如下：

账户名称：申万宏源证券有限公司

银行账号：11001085200059507005

开户行：建行北京丰盛支行

大额支付号：105100003138

4、本计划投资交易费用

本计划在证券经纪机构进行普通证券交易、融资融券交易（若有）产生的佣金、息费等，直接计入当期费用。具体费用标准和支付方式由资产管理人与证券经纪机构在签署证券经纪合同、融资融券合同（若有）时另行约定。

5、上述（一）中所列其他费用，由资产托管人根据有关法律法规、行业自律规则的规定及本合同的约定，在费用发生时，按费用实际支出金额列入当期费用。由资产管理人出具划款指令，资产托管人根据法律法规、行业自律规则的规定、本合同的约定及划款指令从资产管理计划财产中支付。如该费用属于资产托管人或资产托管人指定第三方先行垫付的（包括但不限于由第三方收取的与本计划运作相关的股东账户开户、银行询证及汇划等费用），资产管理人在此授权资产托管人于本计划成立后从资产管理计划财产中一次性扣划至资产托管人或资产托管人指定第三方账户。授权金额为上述费用金额（如存在银行汇划手续费则增加该项金额）。资产管理人不再另行出具划付指令。

6、当托管账户余额不足以支付本计划当期管理费、托管费和运营服务费时，不足部分在以后支付管理费时一并支付，直至不足部分全部支付完毕；如本计划终止时委托资产不足以支付管理费、托管费和运营服务费的，由委托人追加委托资产完成支付。

7、本计划存续期限届满前，资产管理人未按照本合同发布延期通知的，则自存续期届满之日起本计划停止计提管理费、托管费、运营服务费，本合同另有约定的除外。

（四）费用调整

按照本合同约定的变更方式进行费用调整。

（五）资产管理计划的税收

1、本计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。本计划应缴纳的税费（含本计划运营过程中发生的增值税应税行为产生的增值税及其附加税费），由资产管理计划财产承担。除法律法规规定资产管理人负有代扣代缴义务的情形之外，份额持有人必须自行缴纳的税收，由份额持有人负责，资产管理人、资产托管人不承担代扣代缴或纳税的义务。在本计划存续期间及本计划清算结束后的任一时点，若国家税务机关以资产管理人未履行代扣代缴税款义务或资产管理计划财产未足额缴纳相关税费等为理由而向资产管理人追缴相关税款或对资产管理人处以罚款的，资产管理人有权直接以资产管理计划财产支付或从应向份额持有人支付的分红、赎回或清算款项中扣除（现金余额不足的有权变现资产管理计划财产）或在资产管理人代为履行相应的义务或承担相应的责任后就补缴的税款和罚款向份额持有人追偿。

2、本计划运营过程中发生的增值税应税行为产生的增值税及其附加税费，由资产管理计划财产承担，以资产管理人为纳税义务人。资产管理人应根据国家税收相关法律法规规定核算本计划运营业务的增值税应纳税额及其附加税费。增值税应纳税额及其附加税费金额确定后，资产管理人应通知资产托管人将相应的金额从托管账户划付至资产管理人指定收款账户，由资产管理人按照规定的纳税期限申报缴纳本计划运营业务增值税及其附加税费。在本计划存续期间由于税款缴纳按一个计税周期汇总计算，每日计提的应计税额与实际缴纳税额可能存在差异，并将对估值日计算和披露的资产管理计划单位净值带来一定影响。如国家税收法律法规或国家税务机关将来另有规定，资产管理人将进行相应调整。

本计划运作过程中，所适用的税收会计处理规则可能会由于国家相关税收政策或资产管理人主管税务机关指导意见调整而发生变化，资产管理人将进行相应调整。由此产生的税款追溯调整计提或未来税款计提规则调整可能会对资产管理计划财产产生影响，投资者收益可能由此受到不利影响。

第十六章 资产管理计划的收益分配

（一）可供分配利润的构成；

本计划利润是指计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，本计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动收益后的余额。本计划可供分配利润为截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（二）收益分配原则，包括订明收益分配的基准、次数、比例、时间等；

（1）本计划的收益分配方式为现金方式和红利再投资。本计划收益分配默认采用现金方式，红利再投资是将现金红利按照计划分红除权日的计划份额净值自动转为计划份额。

（2）同等份额的享有同等分配权。

（3）收益分配基准日的份额净值减去每份份额收益分配金额后不能低于本计划初始面值。

（4）当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。

（5）计划份额持有人可以选择收益分配方式。计划份额持有人变更收益分配方式的，应当向管理人提交申请，由注册登记机构进行处理。

（6）在符合分红条件和收益分配原则的前提下，实际收益分配比例、分配次数、分配时间和分配金额、是否分配由管理人确定。

（三）收益分配方案的确定与通知；

存续期内，进行收益分配的，由管理人计算可供分配利润并拟定计划收益分配方案，收益分配方案须载明可供分配利润、收益分配基准日、收益分配发放日、分配金额、分配方式等内容。管理人应将分配方案发送给托管人，托管人在收到之日起5个工作日内完成复核，由管理人按本合同“信息披露与报告”章节约定的方式及时向资产委托人披露经复核的收益分配方案。

托管人仅对收益分配的总金额进行复核。

（四）收益分配的执行方式。

管理人依据收益分配方案的规定向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时将可供分配款项划付至委托人账户，该账户应与本合同约定的资产委托人交付委托资产的银行账户一致。

第十七章信息披露与报告

（一）信息披露的形式

本计划的信息披露可选择下列任何一种方式进行,并自披露之日起五个工作日届满之日视为送达投资人:

- 1、寄送给投资人。
- 2、包括但不限于在托管人、管理人、基金业协会网站等公布。
- 3、传真、电子邮件或手机短信等。

4、如委托人办理资产管理计划认购、追加或提取计划份额等业务时留有传真号、电子邮箱、手机号码及电话号码等联系方式的,资产管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知资产委托人。资产委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知资产管理人。资产委托人联系方式变更未及时通知资产管理人的,资产管理人采用原联系方式通知资产委托人视为履行了信息披露义务。

（二）信息披露的内容及时间

1、资产管理计划合同、计划说明书和风险揭示书

资产管理人或其委托的销售机构,应当在资产管理计划募集时披露资产管理计划合同、计划说明书和风险揭示书。

2、自计划成立之日起,管理人于每个会计年度截止日后4个月内编制完成年度报告,经托管人复核财务等数据后向投资人披露计划运作期内投资情况、期末资产配置、期末净值、报告期内风险控制等情况,资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的,管理人可以不编制资产管理计划年度报告。年度报告包括但不限于下列信息:

- (1) 管理人履职报告。
- (2) 托管人履职报告。
- (3) 资产管理计划投资表现。
- (4) 资产管理计划投资组合报告。
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有)。
- (6) 资产管理计划财务会计报告。
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用,包括计提基准、计提方式和支付方式。
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况(如有)。

(9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

(10) 中国证监会规定的其他事项。

3、自计划成立之日起，管理人于每个自然季度结束之日起一个月内，编制完成季度报告，经托管人复核财务等数据后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息，资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告。季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

4、计划终止，管理人应编制资产管理计划事务的清算报告，并送达投资人。

5、管理人每周向投资人发送经托管人复核的资产管理计划份额净值材料。

6、资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。

7、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划的，管理人应通过公司网站、电子邮件、录音电话、传真等任一方式向投资者充分披露。

8、资产管理人应当在开放期向资产委托人披露申购、赎回价格。

（三）管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径等，按照相关法律法规、中国证监会的规定、自律规则或相关监管机构的要求提供。

（四）除按照《基金法》、《指导意见》、《暂行规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《运作规定》及其他相关法律法规、自律规则中关于信息披露的有关规定及本合同约定进行披露以外，资产管理人、资产托管人、资产委托人及其他相关机构对所获取的本计划非公开披露的全部信息、商业秘密、个人隐私等信息负有保密义务，不得向任何第三方泄露。法律法规、自律规则另有规定的以及审计需要的除外。

如下情况不应视为资产管理人或资产托管人违反保密义务：

1、非因资产管理人和资产托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

2、资产管理人和资产托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会、中国基金业协会、中国期货业协会等监管机构、自律组织的命令决定或审计需要所做出的信息披露或公开。

（五）如果金融监管部门、行业自律组织对资产管理计划信息披露规定进行修订或/和更新，则本计划的信息披露事项约定以金融监管部门、行业自律组织修订或/和更新后的规定为准。

第十八章 风险揭示

资产管理人向资产委托人作出如下风险提示：

本资产管理计划面临包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理合同是基于中国基金业协会发布的《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，资产管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致的风险。投资者应当认真阅读本合同，理解本合同的全部条款，独立做出是否签署本合同的决定。

2、资产管理计划外包事项所涉风险；

（1）运营服务事项所涉风险

如运营服务机构未按照法律法规规定或运营服务协议约定履行职责，可能导致本计划财产遭受损失。

（2）由同一机构提供运营服务和托管服务的风险

本资管计划由申万宏源证券有限公司担任托管人，同时管理人聘请申万宏源证券有限公司为其就本资管计划提供份额注册登记、估值核算相关运营服务。申万宏源证券有限公司已将托管职能和基金服务职能进行分离，恰当的识别、管理、监控潜在的利益冲突。但在同时提供上述服务的情况下，仍可能存在一定的利益冲突风险。

3、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划可能面临管理人未能完成在基金业协会备案手续或迟延完成备案手续，从而导致本计划无法投资或迟延投资，给投资者造成损失的风险。届时，本计划将按照本合同约定进行清算。本计划清算时将扣除产生的相关费用后，向投资者分配本计划剩余财产，投资者最终收到的金额可能小于投资的本金。

4、不设置预警/止损操作可能引起的特定风险

本计划不设置预警、止损操作，计划资产可能发生大幅亏损，甚至本金全部损失。

5、资产管理计划份额转让所涉风险（如有）

份额转让实行非担保交收，转让合同履行风险由转让方、受让方自行控制，因此资产管理计划份额转让可能对转让方或受让方带来风险。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

资产管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于 R4 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C4、C5 的合格投资者及专业投资者。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险、上市公司经营风险等。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

6、募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

资产管理人的责任承担方式：

- (1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- (2) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已交纳的款项，并加计人民银行同期活期存款利息。

7、投资标的风险

(1) 本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

(2) 本计划投资人需要遵守法律法规、监管机构及员工持股计划关于信息敏感期不得买卖股票、法定锁定期及归属锁定期（如适用）等限制性规定，遵守以上限制性规定有可能导致本计划无法在预期时间内变现，从而为投资人带来流动性风险

(3) 融资融券风险

本计划可以参与融资融券交易，可能面临包括但不限于以下风险：

① 因资产管理人或本计划自身变化原因导致损失的风险，原因包括但不限于：资产管理人在从事融资融券交易期间，因法律法规规定或监管原因导致资产管理人或本计划被暂停或取消融资或融券资格；资产管理人信用资质状况发生变化导致证券公司降低其授信额度，并由此导致资产管理人不能从事融资融券交易或该资产管理人适用的相关风险控制指标被证券公司单方面提高；因本计划自身原因导致其资产被司法机关或其它有权机关采取财产保全或强制执行措施，或者出现终止、清算情况时，本计划将面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险；因本计划不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险；本计划融资融券交易被证券公司强制平仓或终止时，若参与融资融券交易的担保物不足以清偿证券公司债务的，本计划其他财产面临被证券公司追偿的风险。

② 政策风险，包括但不限于：因交易所、监管机关要求或证券公司自身管理需要发生融资融券标的证券范围调整、可充抵保证金证券范围或折算率调整、标的证券暂停交易或终止上市、保证金比例调整、预警线、平仓线指标调整等情况，本计划将可能面临被证券公司限制交易或提前了结融资融券交易的风险；由于国家法律、法规、政策的变化，证券交易所交易规则的修改等原因，可能会对参与融资融券业务的本计划造成经济损失。

③ 市场风险：在融资融券合同有效期内，证券公司可能调高融资利率或融券费率，本计划将面临融资融券成本增加的风险。

④ 杠杆风险：融资融券交易与普通证券交易不同，具有财务杠杆放大效应，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

⑤ 委托人已知悉并同意，若本单一计划参与融资融券业务，只进行融资交易不进行融券

交易，并且相关融资款项仅用于购买【金科地产集团股份有限公司（股票代码：000656）】的股票，不得用作其他用途。

⑥委托人已知悉并自愿承担本计划参与融资融券交易的投资风险。当本计划参与的融资融券交易维持担保比例低于《融资融券业务合同》及相关申请文件等约定的平仓线或最低线时，管理人收到融资融券服务提供券商补交担保物通知的当日通过邮件、电话、传真或书面方式中的一种或多种方式通知委托人，委托人应在通知要求的时间内足额追加风险调整资金至托管户，使维持担保比例符合《融资融券业务合同》及相关申请文件等相关约定；如委托人未在通知要求时间内足额追加风险调整资金导致违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。通知的发送以管理人的发送记录为准。

特别提示：若本单一计划参与融资融券交易，委托人知悉并同意相关约定以融资融券服务提供券商与本单一计划签订的《融资融券业务合同》及相关申请文件等为准。如因委托人原因导致本计划在履行《融资融券业务合同》及相关申请文件等过程中违约或被强制平仓，则全部风险由委托人自行承担。

8、税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

9、关联交易风险（如有）

本计划可投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或进行其他关联交易，这将构成本计划与相关方的关联交易，可能存在关联交易风险。

10、法律和政策风险

本计划在管理或运作过程中，需要遵守国家和地方法律、法规及政策的规定。国家和地方法律、法规的变化以及相关货币政策、财政政策、产业政策、区域政策及政府对市场监管政策的调整可能会导致本计划需要进行相应的调整、遭受损失甚至终止的风险。

11、不可抗力风险

战争、自然灾害、政府行为等不可抗力可能导致资产管理计划财产有遭受损失的风险，以及资产管理人、资产托管人可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响本计划份额申购、赎回的风险。金融市场危机、行业竞争等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致份额持有人利益受损。

在资产管理合同终止时，因投资组合内股票停牌等不可抗力的因素，本资产管理计划可采取现金部分先行给付等相关处理方式。现金部分按资产委托人持有的计划份额比例，扣除相关费用后分配给资产委托人，非现金部分将在变现并扣除相关费用后，分配给资产委托人。

12、操作或技术风险：

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响，例如IT系统故障等风险。这种技术风险可能来自资产管理人、资产托管人、证券/期货经纪机构、份额登记机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

在实际操作中，由于资产管理人的审批流程、决策机制、后台操作等存在时滞，可能导致投资产生一定的损失。

13、估值风险

本计划采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示本计划所持资产的实际价值，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估本计划资产净值。管理人将在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，与托管人协商，调整相应投资品种的估值，使调整后的本计划资产净值更公允地反映计划资产价值。

14、提取份额受限的风险

本计划非开放日不接受委托人的提取申请。委托人将面临在投资期内无法按意愿提取份额的风险。

15、本计划存在提前终止的风险

如发生本合同约定的情形，本计划存续期限将相应提前终止，委托人将面临无法按预期获得收益或无法按意愿退出投资的风险。

16、关于风险收益特征的风险揭示

资产管理人将本计划评级为R4投资品种。管理人对本计划的风险评级及对投资者的风险评级的方法和方式可能影响测评结果的客观性和准确性。管理人提出的适当性匹配意见不表明本计划的风险和收益做出实质性判断或者保证，其履行投资者适当性职责不能取代委托人的投资判断，不会降低本计划的固有风险，也不会影响委托人依法应当承担的投资风险、履约责任以及费用。（若代销机构根据其风险等级划分方法对本计划风险收益特征的评定与

本合同约定不一致，投资者通过代销机构申/认购本计划份额的，产品风险等级及投资者适当性匹配意见以代销机构为准）。

托管人及运营服务机构不参与本计划的风险评级和投资者的适当性评估程序。

17、托管风险

如托管人未按照法律法规规定或资产管理合同约定履行托管职责，可能导致本计划财产遭受损失。

托管人仅按照本合同约定的标准及范围履行投资监督职责，并不能确保管理人完全按照相关法律法规及本合同约定进行投资运作。

18、管理人/托管人不能继续履行职责的风险

如在本计划存续期间管理人/托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被监管部门撤销相关业务许可而不能继续履行资管合同项下的职责，可能会对本计划产生不利影响。

19、资产管理合同变更风险

管理人有可能按照本合同约定的程序和方式变更本合同条款，该等变更不一定与委托人意愿一致，委托人可能面临本合同条款变更的风险。

第十九章 资产管理合同的变更、终止

（一）资管计划合同的变更

1、以下合同变更事项可由管理人和托管人协商一致后决定：

（1）调低管理人、托管人、运营服务机构的报酬标准。

（2）因法律法规、中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向资产委托人披露变更的具体内容。此情况下，若资产委托人不同意变更事项，管理人应及时与资产委托人、资产托管人共同协商，协商不成的，终止本合同。

（3）对本合同的修改，对资产委托人利益无实质性不利影响或不会导致本合同当事人权利义务关系发生变化。

（4）法律法规、中国证监会、基金业协会规定可由管理人和托管人协商决定的其他事项。

管理人应该按照本合同约定向资产委托人披露变更的具体内容。

2、投资经理的变更可由管理人和委托人按照本合同约定的程序，协商一致后决定，并由管理人按照本合同约定及时通知托管人。

3、以下合同变更事项需取得管理人、托管人及所有委托人一致书面同意。

- (1) 决定修改资产管理合同的重要内容或者提前终止资产管理合同。
- (2) 决定更换管理人、托管人。
- (3) 决定调高管理人、托管人的报酬标准。
- (4) 资产管理计划改变投向和比例。

此种情形下，若本合同当事任一方不同意变更事项，无法达成协商一致的，资产管理人应组织资产委托人、资产管理人共同协商是否终止本合同。

4、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。

(1) 新任管理人由托管人和委托人协商一致同意并共同选定。托管人和委托人应当于上述管理人职责终止事项发生后【20】个工作日内发起新任管理人的选定程序。管理人职责终止事项发生后6个月内未选定新任管理人的，本计划终止。

(2) 新任管理人产生之前，由中国证监会或其他有权机构指定临时管理人。

(3) 新任管理人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更管理人生效。

(4) 管理人职责终止的，管理人应妥善保管本计划业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理本计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人或临时管理人应与托管人核对本计划资产总值和净值。

(5) 管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对本计划资产进行审计，并将审计结果告知资产委托人，同时向相关监管机构备案，审计费用在本计划资产中列支。

(6) 管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除本计划名称中与原任管理人有关的名称字样。

本部分关于管理人变更条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前通知委托人后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需事先征得委托人同意。

5、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接。

(1) 新任托管人由管理人和委托人一致同意并共同选定。管理人和委托人应当于上述托管人职责终止事项发生后【20】个工作日内发起新任托管人的选任程序。托管人职责终止事项发生后6个月内未选定新人任托管人的，本计划终止。

(2) 新任托管人产生之前，由中国证监会或其他有权机构指定临时托管人。

(3) 新任托管人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更托管人生效。

(4) 托管人职责终止的，托管人应当妥善保管本计划资产和本计划托管业务资料，及时向临时托管人或新任托管人办理移交手续，新任托管人或者临时托管人应当及时接收。新任托管人或临时托管人应与管理人核对本计划资产总值和净值。

(5) 托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对本计划资产进行审计，并将审计结果告知委托人，同时向相关监管机构报备；审计费用在本计划资产中列支。

本部分关于托管人变更条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规及监管机构规定的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前通知委托人后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需事先征得委托人同意。

(二) 资产管理计划展期

资产委托人、资产管理人、资产托管人在本计划到期前5个工作日内未提出书面异议，则由资产管理人发布延期公告自动展期1年。

(三) 资产管理计划终止的情形

发生下列任一情形的，本资管计划终止：

1、本计划约定的存续期限届满前，本合同任一当事人提出展期异议的。

2、资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接的。

3、托管人被依法撤销基金托管资格或依法解散、宣告破产、被撤销等，且在六个月内没有新的托管人承接的。

4、自资管计划成立之日起半年内备案不成功。

5、经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的。

6、当委托人的委托资产发生权属变更等可能影响管理人资产管理业务正常运行的重大变更时，管理人有权按合同约定提前终止资产管理委托。

7、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

(四) 资管计划合同的终止

本资产管理计划终止情形发生的，应按照合同约定开始清算程序，本计划清算程序完毕后，资产管理合同终止。

(五) 管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第(三)项第4点约定的情形除外。

第二十章资产管理计划资产的清算

（一）资产管理计划财产的清算

管理人自本计划发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产。

（二）资产管理计划财产清算小组

1、计划财产清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

2、计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算小组各成员的具体职责以本章约定为准，本节未约定的，清算小组成员可以书面形式进行补充约定。

（三）清算程序

1、本合同终止情形发生后，由计划财产清算小组统一接管计划财产。

2、对计划财产进行清理和确认。

3、对计划财产进行评估和变现。

4、制作清算报告。

5、将清算报告告知资产委托人。

6、对计划财产进行分配。

（四）清算报告的告知安排

管理人或管理人聘请的运营服务机构应于本计划终止日后5个工作日内开始组织清算，并在15个工作日内完成计划财产的清理、确认、评估和变现等事宜，编制清算报告并发送给托管人。托管人于收到清算报告后5个工作日内完成复核并盖章后发送回管理人。管理人应于收到后5个工作日内向资产委托人披露清算报告。

（五）清算费用

清算费用是指计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由计划财产清算小组优先从计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

1、聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬。

2、计划财产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用。

3、信息披露所发生的费用。

4、诉讼仲裁所发生的费用。

5、其他与清算事项相关的费用。

(六) 计划剩余财产的分配

依据资产管理计划财产清算的分配方案,将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划财产清算费用、应由资产管理计划财产承担的税款、资产管理计划其他费用及债务后,按照本合同约定进行分配。分配顺序如下:

1、支付清算费用。

2、缴纳所欠税款(资产委托人必须自行缴纳的税收,由资产委托人负责,资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务)。

3、支付管理费、托管费、运营服务机构服务费等计划相关费用。

4、清偿计划债务。

5、剩余计划财产扣减应计提的业绩报酬后(如有)按委托人的持有的份额数及对应份额净值进行分配。

6、向管理人、投资顾问(如有)支付业绩报酬(如有)。

特别地,如分配时托管账户中的现金不足以按照上述顺序进行分配时,优先用于支付顺序在前的分配项目。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外,计划财产的分配由管理人向托管人出具划款指令,由托管人复核后办理支付。

(七) 延期清算

若本计划的部分投资标的不能在本章第四条约定的期限内变现完毕的,管理人将本计划届时已完成变现的部分资产按照本合同的约定进行清算。对于其余未能变现的资产,管理人有义务继续变现,变现完成后,管理人进行二次清算并分配。管理人应制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并按照清算报告的披露程序向资产委托人进行披露并按照相关约定及时向中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。

二次清算期间,管理人、托管人、运营服务机构不计提管理费、托管费、运营服务机构服务费,管理人不再进行投资运作。二次清算流程同一次清算。

本计划持有多个未能按期变现投资标的的,管理人可按本条款约定进行多次变现及清算。

(八) 清算报告的告知安排及账册保存。

计划财产清算小组做出的清算报告,管理人应选择通过本合同邮寄、网站、电子邮件、传真等任一方式向资产委托人披露,并报中国证券投资基金业协会备案。

计划财产清算账册及文件由计划资产管理人保存不低于20年。

（九）资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

第二十一章 资产管理计划有关文件档案的保存

（一）资产管理人应保存资产管理计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，资产托管人应保存资产管理计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

（二）资产管理人和资产托管人应按各自职责完整保存原始凭证、记账凭证、资产管理计划账册、会计报告、交易记录和重要合同等，保存期限为自本计划清算终止之日起20年。法律法规、行业自律规则另有要求的，按照法律法规、行业自律规则规定执行。

（三）资产管理人签署重大合同文本后，应按本合同约定及时将合同文本正本送达资产托管人处。资产管理人应及时将与本计划账务处理、资金划拨等有关合同、协议以传真或电子邮件发送扫描件的方式发送给资产托管人。

（四）资产管理人或资产托管人变更后，未变更的一方有义务协助接任人接收本计划的有关文件。

第二十二章 违约责任

（一）违约责任

当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规规定或本合同约定，给计划财产或资产委托人造成损失的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任。

（二）免责条款

1、管理人及/或托管人不对下列情形下计划财产遭受的损失承担任何责任：

（1）管理人及/或托管人按照中国证监会、基金业协会、期货业协会、交易所等监管机构的规定或当时有效的法律法规作为或不作为而造成的损失等。

（2）在没有故意的情况下，管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

（3）托管人对因计划财产对外投资产生的存放或存管在托管人以外机构的计划财产由

于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给计划财产造成的损失等。

(4) 管理人对因计划财产对外投资产生的存放或存管在托管人以外机构的计划资产，在谨慎挑选并要求保证计划财产安全的前提下，就该机构对计划财产的安全保管义务及该机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给计划财产造成的损失等。

(5) 不可抗力。

(6) 法律法规规定及本合同约定的其他情况。

2、资产委托人理解计划财产的投资、运作、托管面临本合同《风险揭示书》中列举的各类风险，管理人及托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。

3、本合同签署之后发生的不可抗力事件导致合同当事人无法全部履行或部分履行本合同的，任何一方当事人不承担违约责任，但是，各方当事人应当在合理范围内勤勉尽责，以降低此类事件对计划财产和其他当事人的影响。

4、管理人未能事前就其关联方名单明确告知托管人致使本计划资产发生违规投资行为的，管理人承担责任。

(三) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护计划资产委托人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四) 本合同所指“损失”均为直接损失。

(五) 本合同任何一方未经其他方事先书面同意，不得使用其他方的商标、标识、商业信息等知识产权，否则守约方有权解除本合同并向违约方追究责任。

(六) 托管人承担法律法规规定以及本合同约定的相关责任及义务。如管理人对托管人所承担的责任进行虚假宣传，或以托管人名义或利用托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动，托管人有权向管理人追究违约责任和侵权责任。

第二十三章 法律适用与争议处理

(一) 本合同适用于中华人民共和国法律，并在中华人民共和国境内（不包含港澳台地区）接受管辖。

(二) 各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人

应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，仲裁地在北京，按提交仲裁申请时该会有效之仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力，除裁决另有约定外，仲裁费由败诉方承担。

(三) 争议处理期间，除争议部分外合同当事人应本着恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同其余无争议部分，维护双方的合法权益。

第二十四章 资产管理合同的效力

(一) 资管计划合同的成立与生效

1、资管计划合同的成立

资管计划合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同由管理人及托管人先行以纸质形式签署，经管理人加盖公章或合同专用章、托管人加盖公章或合同专用章、委托人加盖公章以及三方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字或盖章后即成立，三方各保留一份原件。

2、资管计划合同的生效

本合同自本计划成立之日起生效。

3、资管计划合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

4、管理人应负责向托管人交付一份投资者、管理人及托管人签署的资管计划合同原件，并确保交付至托管人的资管计划合同原件真实、有效、完整，由于管理人未履行本条款规定义务造成的所有损失、责任及不利后果均由管理人承担，与托管人无关。

(二) 资管计划合同的期限

资管计划合同的存续期限与本资管计划的存续期限一致，自生效之日起算；但本资管计划合同生效期届满后计划财产的清算、违约责任、争议的处理等条款继续有效。

第二十五章 保密

(一) 本合同各方应就计划资产以及相关信息承担保密责任。除法律、法规的规定和司法机关、监管部门或有权部门要求外，未经对方书面同意，任何一方不得以任何方式披露或利用该信息。

(二) 本合同任何一方未经对方事先书面同意，不得使用对方的商标、标识、商业信息等知识产权，否则守约方有权解除本合同并向违约方追究责任。

(三) 在本合同终止后, 各方当事人均应持续履行保密义务, 保密义务不因本合同的解除、终止而终止。

第二十六章 通知和送达

(一) 合同各方应按照本合同中约定的各自的通讯方式, 以专人、特快专递、传真、电子邮件等方式进行本合同项下相关事宜的通知和相关文件的送到。

(二) 通知在下列日期视为送达被通知方:

- 1、专人送达: 被通知方在签收单或回执单上签收所示日。
- 2、邮寄送达: 被通知方在签收单上或回执单签收所示日, 若通知方自成功寄出之日起5个工作日内未收到被通知方回执或异议的视为已经送达。
- 3、传真: 传真发送当日(通知方应电话确认传真发送成功)。
- 4、采用电子邮件送达的, 以发出方电子系统显示成功发送之日视为送达之日。

(三) 一方通讯地址或联络方式发生变化, 变化方应提前5个工作日内以书面形式通知其他合同方; 如果在合同终止前1个月内发生变化, 变化方应提前3个工作日内以书面形式通知其他合同方。

(四) 如果通讯地址或联络方式发生变化的一方, 未将有关变化及时通知对方, 除非法律另有规定, 未通知方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

第二十七章 其他事项

(一) 本合同履行中, 如果相关法律法规、规范性文件发生变化, 直接适用修订后的相关法律法规、政策、交易所规则等; 同时根据修订后的法律法规、政策、交易所规则等重新修订本合同相应内容。

(二) 本合同如有未尽事宜, 由合同当事人按照有关法律法规、规范性文件及交易惯例等要求处理。

(三) 《期货公司资产管理业务风险揭示书》、《资产合法性及投资者适当性承诺书》以及合同附件是本合同的组成部分, 与合同正文具有相同的效力。

(四) 本合同一式叁份, 各方各执壹份; 每份均具有同等法律效力。

(五) 管理人确认已向委托人说明资产管理业务的风险, 不以任何方式对委托人资产本金不受损失或者取得最低收益做出承诺; 委托人确认, 已充分理解本合同内容, 自行承担风险和损失。

(以下无正文)

(本页为合同编号为【宏源期货-2020-D-07】的《宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划资产管理合同》的签署页，无正文内容。)

委托人（签字/盖公章或合同专用章）：

法定代表人/单位负责人或其授权代表：

日期： 年 月 日

管理人（盖公章或合同专用章）：宏源期货有限公司

法定代表人/单位负责人或其授权代表：

日期： 年 月 日

托管人（盖公章或合同专用章）：申万宏源证券有限公司

法定代表人/单位负责人或其授权代表：

日期： 年 月 日

附件一

追加风险调整资金函

宏源期货有限公司、申万宏源证券有限公司：

2***年**月**日宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划(以下简称“本计划”)

总资产超过本计划净资产的 200%

参与的融资融券交易维持担保比例低于《融资融券业务合同》中约定的平仓线或最低线

我司决定按照《宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资产管理合同”)的约定,追加风险调整资金至托管账户,具体如下:

追加日期: X 年 X 月 X 日

追加金额: X 元

付款账户名称:

付款账户账号:

付款账户开户银行:

付款账户大额支付号:

按照资产管理合同的约定,本次追加的风险调整资金仅用于资产管理合同第八章第(八)条约定的风险控制之目的,不作为资产委托人对本计划份额的追加,也不做份额登记,追加、提取风险调整资金不受本计划开放日限制。

按照资产管理合同的约定,当追加风险调整资金后,本计划总资产连续【3】个工作日不超过本计划净资产的【200%】且符合融资融券服务提供券商的提取标准和提取条件,该笔风险调整资金可退回。

特此函达

委托人名称(盖章):

年 月 日

附件二

风险调整资金提取申请函

宏源期货有限公司、申万宏源证券有限公司：

我司按照《宏源期货金科股份员工持股 2 号单一资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）的约定，于 2***年**月**日追加风险调整资金至托管账户。

按照资产管理合同的约定，当追加风险调整资金后，本计划总资产连续【3】个工作日不超过本计划净资产的【200%】且符合融资融券服务提供券商的提取标准和提取条件后，该笔风险调整资金可退回。现已满足资产管理合同的前述约定条件，特申请对 X 年 X 月 X 日追加的风险调整资金进行提取，请按追加风险调整资金的划款路径原路返还。

特此申请。

委托人名称（盖章）：

年 月 日